TÀI LIỆU VOLUME TRADING- GRABTRADER từ 16/7/2019- 23/4/2021
Quản trị viên: Nguyễn Quang Trung

Collected by Dương Thanh Phong

16/7/19

Chào toàn thể các anh chị em tham gia group.
Công cụ volume trong thị trường FX không dễ dàng phân tích như trong giao dịch chứng khoán vì tính chất phi tập trung của thị trường forex, công cụ volume trong thị trường FX thực chất không phản ánh được bản chất thị trường như chứng khoán. Nhưng đây là công cụ rất tốt để theo dõi hành vi của các MM (BigBoy) cho dù họ cố gắng dấu kín hoạt động không muốn chia sẻ cho các retail Trader như anh em chúng ta.
Nhưng cho dù cố gắng ẩn mình trên thị trường thì họ vẫn để lại dấu chân của mình khi tiến hành giao dịch, đó là các vùng giá hoạt động tích cực với volume bất thường.
Như anh em đã biết thì volume trên thị trường FX thực chất là số lần giá giao động trong khoảng thời gian nào đó (phút, giờ, ngày ...), volume cao bất thường chứng tỏ các tổ chức lớn đang hoạt động tích cực tại khu vực giá đó, khi giá di chuyển khỏi khu vực giá đó thì phe mua hoặc bán đã thất thế và thị trường bắt đầu di chuyển theo lực của phe chiến thắng.
Theo kinh nghiệm của bản thân mình thì chúng ta không quan tâm nhiều đến cây nến tăng hay giảm ngay khi hình thành có volume cao bất thường, mà nên quan sát hành vi giá sau khi thị trường di chuyển khỏi khu vực hoạt động tích cực. Cần lưu ý là giá có phá vỡ vùng sideway hay breakout vùng hỗ trợ hay kháng cự hay không.
Sau khi xuất hiện cây nến có volume bất thường nên đánh dấu khu vực và nhìn lại mô hình giá trong quá khứ để coi giá đang hoạt động trong khu vực nào trên đồ thị.
Anh em có thể sử dụng thêm công cụ Bollingerband để xác định trend, vùng giá bóp lại hay vùng mở rộng....

Công cụ hỗ trợ có thể sử dụng là trendline hoặc các vùng giá đánh dấu bằng khung chữ nhật, hạn chế sử dụng đường kẻ ngang vì dễ làm nhầm lẫn vì giá có tính chất dao động bất thường, khi giá đi vào vùng khung kẻ ngang thì chú ý quan sát volume bất thường.

Tại sao chúng ta phải quan sát trong vùng giá? bởi vì khi các tổ chức lớn giao dịch sẽ có tính định hướng thị trường rất cao vì khối lượng họ chiếm phần lớn trên thị trường, nhưng thị trường forex có rất nhiều cá mập cùng tranh nhau kiếm ăn nên không phải lúc nào thị trường cũng đi ngay theo ý muốn của họ do khối lượng lệnh giao dịch của họ rất lớn nên cần có khối lượng đối ứng đáp ứng đủ khối lượng mua hay bán của họ. Phần này mình sẽ có bài phân tích riêng để không loãng bài.
Phần mở đầu này xin tạm dừng ở đây, nếu anh chị em hứng thú thì mình sẽ giành thời gian hầu chuyện anh chị em tiếp.
Anh chị em có thể nghiên cứu tạm 1 hình ảnh dưới đây và cùng thảo luận.
Happy trading!



Để hiểu mục đích sử dụng volume trong phân tích thị trường ngoại hối thì cần hiểu bản chất giao dịch trên thị trường của các BigBoy (MM), vốn chỉ chiếm khoảng 5% số lượng Trader nhưng lại nắm giữ tới trên 90% khối lượng giao dịch trên toàn cầu.

Vậy để họ tiến hành mua bán thành công thì khối lượng khớp lệnh tới từ đâu?

Ví dụ: 1 công ty từ Nhật muốn chuyển 1 tỷ USD đầu tư sang Mỹ thì họ làm thế nào? Tất nhiên họ phải thông qua ngân hàng bán Yên Nhật để mua USD chuyển đi, khi ngân hàng thực hiện lệnh thì tỷ giá USDJPY sẽ tăng lên, vậy 1 tỷ USD lấy từ đâu? Vấn đề là công ty Nhật sẽ ký hợp đồng với ngân hàng theo một tỷ giá nhất định trong khung nào đó do hai bên thương thảo, thường là chốt tỷ giá lúc 1.15 p.m hoặc 4 p.m theo giờ London (ECB fix và WM/Reuters benchmark rates - https://www.kantox.com/.../glo.../wmreuters-benchmark-rates/)

WM/Reuters benchmark rates - Kantox

WM/Reuters benchmark rates are also known as the 4 pm fix because these spot and forward foreign exchange rates are announced at 4 pm London time

KANTOX.COM

Ngân hàng sẽ thay mặt khách hàng gom 1 tỷ USD trên thị trường ngoại hối để thực hiện giao dịch cho khách hàng. Vậy họ sẽ mua như thế nào nếu không có đủ 1 tỷ ngay thời điểm họ mua, lúc này ngân hàng sẽ tiến hành thao túng thị trường liên kết với các đối tác tin cậy trong các group kín để gom hàng hoặc ưu tiên mua trước khi đặt lệnh mua USD trên EBS platform và bắt đầu quy trình săn stoploss của các cá mập khác và các trader nhỏ lẻ. Hành vi này đã bị phát hiện và rất nhiều ngân hàng lớn đã bị phát, ví dụ như Citi bank bị phạt tổng cộng tới hơn 1 tỷ USD bởi CFA - https://www.fca.org.uk/.../fin.../final-notice-citi-bank.pdf

Song song với việc nắm chắc phần thắng thì ngân hàng cũng sẽ tham gia vào việc mua bán theo các hợp đồng lớn bằng cách mua trước hay bán trước 1 khoản tiền nhất định và họ sẽ kiếm được rất nhiều tiền từ các Bigdeal cho các khách hàng VIP.

Nhưng tiền phạt như muối bỏ biển so với lợi nhuận mà ngân hàng kiếm được do đó tình trạng lợi dụng ECB fix hay WM/Reuters rates (thời điểm công bố tỷ giá giao ngay và kỳ hạn) không vì thế mà suy giảm, có chăng họ kín đáo hơn trước rất nhiều.

Còn các tổ chức tài chính lớn khác như các quỹ giao dịch, hedfund ... họ kiếm ăn ra sao?

Nếu coi các tổ chức tài chính lớn / ngân hàng đại ca là sư tử thì các công ty quỹ, dealer, hedfund... như các đàn linh cẩu chuyên đi tìm các con mồi nhỏ hơn và các trader nhỏ lẻ như đàn linh dương trên thảo nguyên, đôi khi cả sư tử và linh cẩu cùng tập trung săn linh dương nếu đó là đàn linh dương lớn, còn khi linh dương ít thì sư tử sẽ đi săn linh cẩu, đôi khi đàn linh cẩu sẽ săn những con sư tử đi lẻ bầy như tình cảnh Deutsche bank hiện nay :):):)
Tuy nhiên các bank đại ca dấu mình rất kỹ nên chúng ta chỉ có thể phát hiện được các dấu vết của các quỹ khi họ tiến hành giao dịch, do đó việc sử dụng Volume cần phải quan sát cả vùng giá và mô hình giá của khung thời gian lớn hơn để đoán hướng đi sắp tới của thị trường.
Tạm thời chia sẻ tới đây kẻo anh chị em tẩu hỏa nhập ma. Anh chị em nếu đọc được Tiếng Anh sẽ tìm được rất nhiều bài viết về tình trạng này trên các website uy tín

Việc sử dụng tick volume cho thấy khu vực giá hoạt động tích cực chứ không cho trader nhỏ lẻ thấy được real volume - tức khối lượng mua bán hoặc stoploss thực sự.
Nhưng nếu bạn xem thật kỹ dấu hiệu thị trường tại các thời điểm mình đã nói ở trên sẽ nhìn thấy dấu chân Bigboy để lại, đặc biệt lưu ý khối lượng lúc 1.15 p.m giờ London (tức 7h15 tối giờ Việt Nam - giờ mùa hè).
Chú ý rằng với các khối lượng mua bán lớn nên không phải lúc nào các Bigboy cùng có đủ khôi lượng đối ứng tại thời điểm khớp lệnh, lúc đó các Bigboy sẽ đi đặt bẫy để khớp hết khối lượng đó. Do đó dựa trên tick volume ta có thể theo dấu Bigboy để tìm cách theo tại các vùng giá có volume thấp tại các vùng S - R hoặc khu vực cung cầu.
Chúng ta cần coi kỹ trên biểu đồ đính kèm có đánh dấu cây nến 13h (giờ London) bằng đường kẻ dọc và các mức volume cao bất thường cùng xu hướng giá, sau đó quan sát các vùng giá có volume thấp sẽ nhận thấy dấu chân Bigboy
Happy trading!



Đầu tiên cần đánh dấu cây nến tại vị trí 13h15 và 16h (giờ London) - Nên sử dụng Tradingview và lấy dữ liệu của ICE vì broker này hoạt động theo giờ Mỹ nên có giá đóng cửa tốt nhất.

Sau đó mở chart Daily hoặc Weekly để có cái nhìn tổng quát hoạt động của thị trường trên khung thời gian lớn và để dễ dàng xác định các khu vực hoạt động tích cực và tiêu cực của giá dựa trên tick volume để xem xét các khu vực giá quay đầu coi volume hoạt động như thế nào
Sau đó để tìm dấu hiệu mua bán thì phải xem xét giá đó hoạt động tích cực ở thời điểm nào bằng cách nhìn trên tick volume hoạt động ra sao so với đường MA và có cao đột biến không?
Nhìn lại mô hình giá gần nhất để xác định khu vực Cung - Cầu có trùng với khu vực hoạt động của Volume hay không?



17/7/19

Có nhiều bạn nhắn tin hỏi về tick volume nên mình post 1 bài cơ bản giúp mọi người sử dụng volume cải thiện kết quả giao dịch. Mình cũng xin nói là công cụ Tick Volume không phải là đũa thần để kiếm tiền ngay trên thị trường, mà phải kết hợp với các công cụ hoặc phương pháp khác

để khai thác thế mạnh của nó. Ưu điểm của Tick Volume là không có độ trễ như các indicator khác và nó giúp ích rất nhiều với những người sử dụng PP Price Action để giao dịch.

Mình xin diễn giải trong ví dụ sau đây:

1/ Trước hết anh chị em mở chart khung thời gian lớn như Monthly để nhìn toàn cảnh thị trường, đanh dấu các vùng giá quan trọng.

2/ Sau đó mở các chart thời gian thấp hơn và cũng đánh dấu

3/ Tiếp tục xem xét mô hình giá

4/ Bắt đầu phân tích Volume + giá

5/ Xác định các vùng giá tiềm năng, đánh dấu lại, khi giá tiến vào vùng đó thì mở chart H1 hoặc M15 để theo dõi volume (nên mở chart M15) - Nên giao dịch sau 13h15 (giờ London) tương đương 7h15 tối giờ VN (mùa hè) vì thanh khoản cao và không mất công chờ đợi. Lý do nên tập giao dịch sau 13h15 thì xin đọc từ bài đầu

6/ Lên tàu cùng BigBoy

Xin xem trong album hình đính kèm

Chào bạn. Spot Forex volume mà chúng ta hay xem free trên các platform thường gọi là tick volume (khối lượng đánh dấu) vì thị trường spot nói chung là phi tập trung, mỗi một Core Liquitidy Provider (CLP)- nhà cung cấp thanh khoản cốt lõi: bank, các tổ chức lớn (LAMX, SAXO bank ...) có khối lượng riêng của từng loại tiền tệ hoặc CFDs giao dịch thông qua cổng của họ, nhưng thường thì KL thực này họ bán theo gói dịch vụ cho các tổ chức. Còn tick volume họ cung cấp free là số lần nhảy giá trên 1 đơn vị thời gian cụ thể. Investing thì mình không biết CLP của họ là ai. Còn trên Tradingview thì có nhiều nguồn giá khác nhau (FXCM, FOREX.COM, SAXO Bank....Không có tick volume chuẩn để so sánh, nên không thể nói bên nào có tick volume chính xác. Nếu bạn muốn có khối lượng thực để phân tích thì phải đăng ký gói dịch vụ, ví dụ của Tradingview (Premium) để nhận dữ liệu khối lượng chính xác của từng sàn giao dịch - Giá khá cao/ tháng và chỉ có khối lượng cho cổ phiếu, hđ tương lai, hđ kỳ hạn, hđ hàng hóa. Broker lớn và uy tín thì tick volume càng sát với KL thực vì họ chỉ làm nhiệm vụ duy nhất là cổng kết nối giữa khách hàng và nhà cung cấp thanh khoản, không can thiệp vào lệnh giao dịch do đó khách hàng sẽ nhận được tick volume thực của CLP

Happy trading!



Antony_sg đã xuất bản trên TradingView.com, Tháng Bảy 17, 2019 15:47:17 BST
FX_IDC:XAUUSD, 1W 1416.26 ▲ +10.10 (+0.72%) O:1415.16 H:1419.75 L:1400.20 C:1416.15



Được tạo với TradingView

Antony_sg đã xuất bản trên TradingView.com, Tháng Bảy 17, 2019 15:50:34 BST
FX_IDC:XAUUSD, 1D 1417.41 ▲ +11.25 (+0.8%) O:1406.16 H:1418.10 L:1400.20 C:1417.41



Được tạo với TradingView

Antony_sg đã xuất bản trên TradingView.com, Tháng Bảy 17, 2019 16:03:58 BST
FX_IDC:XAUUSD, 240 1420.03 ▲ +13.87 (+0.99%) O:1411.70 H:1420.30 L:1409.77 C:1420.03



Được tạo với TradingView

Antony_sg đã xuất bản trên TradingView.com, Tháng Bảy 17, 2019 16:13:55 BST
FX_IDC:XAUUSD, 60 1421.63 ▲ +15.47 (+1.1%) O:1418.15 H:1422.30 L:1417.91 C:1421.66



Được tạo với TradingView



29/7/19

Xin chào tất cả anh chị em.

Trong bài trước ad đã đưa vấn đề gian lận trong thị trường và cách các BigBoy tích lũy khối lượng trên thị trường tại thời điểm ECB fix và WM/Reuters rates.

Nhưng trong quá trình hoạt động các BigBoy vẫn tham gia tạo lập thị trường và tìm kiếm thanh khoản cho các khối lượng giao dịch lớn. Và để che mắt các cá mập khác về khối lượng của mình thì cần phải làm thị trường rối loạn và tích lũy khối lượng sao cho không để lại dấu vết trước khi lái giá theo ý muốn. Thông thường BB sẽ làm thị trường đi không có xu hướng rõ ràng như sideway trong biên độ hẹp hoặc bẫy giá để tích lũy khối lượng. Sau khi tích lũy đủ khối lượng, BB sẽ đẩy giá tăng hoặc giảm rất nhanh, sau đó lại tích lũy tiếp.

Tại sao giá không đi ngay mà lại tạo các vùng sideway rồi mới đi tiếp?

Ví dụ để mua EURthì BB cần khối lượng bán đủ lớn để khớp lệnh từ phe bán và khi hấp thụ hết khối lượng của phe bán thì BB dư mua và theo nguyên tắc khớp lệnh giá sẽ tìm lên các khối lượng chờ bán lớn hơn ở vùng giá trên, khi đó sẽ kéo giá tăng lên. Khi thị trường chuyển động các cá mập và retail traders khác cũng nhào mua theo làm cho thị trường dư mua và giá tiếp tục khớp lệnh ở các vùng giá cao hơn. Tới mức kỳ vọng BB sẽ chốt khối lượng 1 phần dựa trên khối lượng mua mới tham gia thị trường. Lúc này thị trường tràn ngập lệnh bán và cân bằng khối lượng mua làm cho giá đi ngang. Nếu BB chưa mua khối lượng họ sẽ lái giá đi xuống bằng cách bán thêm 1 phần nhằm hấp thu hết khối lượng mua và làm giá đi xuống và thị trường lại đua bán theo, nhưng họ sẽ luôn luôn bảo vệ thị thế mua ở 1 mức giá nhất định và sẽ giữ cho giá không thấp hơn lúc họ mua, khi giá tiệm cận vùng giá mua của BB thì họ sẽ gia tăng khối lượng mua để hấp thu hết khối lượng bán để đẩy giá đi lên trở lại. Lúc này thị trường cạn kiệt khối lượng bán và giá bị đẩy lênh theo cơ chế khớp lệnh.

Với khối lượng bán của BB thì ngược lại.

Vậy làm thế nào để biết BB đã tích lũy đủ khối lượng thì thực sự là khó, nhưng hoạt động lái thì trường chuyển động thì thường để lại dấu vết bằng thanh tick volume lớn.

Do vậy để lần theo dấu chân BB thì chúng ta cần quan sát khi thị trường sideway rồi volume biến động sau đó quan sát hướng thanh nến thoát khỏi vùng sideway để theo dấu BB. Lưu ý rằng

khi BB tạo trap cũng sẽ làm thanh giá đột biến, nhưng volume thấp, tránh nhào ngay vô sẽ tránh được bẫy để không phải đu đỉnh hoặc đáy.
Happy trading!



31/8/19

Hello fellow

Sau thời gian bận rộn công việc, nay ad rảnh chia sẻ tiếp phương thức sử dụng Volume trong giao dịch forex.

Như chia sẻ kỳ trước, thị trường giao dịch ngoại hối là phi tập trung (OTC / Over-The-Counter / giao dịch qua quầy - phi tập trung), do đó chỉ số khối lượng là tính theo số lần biến động giá - vì vậy nó không phản ánh trung thực khối lượng thực trên thị trường.

Vậy làm cách nào sử dụng khối lượng trong giao dịch - rất may là bên cạnh phương thức giao dịch thông thường là lấy chỉ số các cặp ngoại hối giao (spot) ngay để mua bán - thực ra retail trader đang đặt cược vào thị trường - thì giao dịch future cho chỉ số khối lượng thực vì nó phải qua sàn (vd: future CME GLOBEX) và sàn phải cung cấp khối lượng thực.

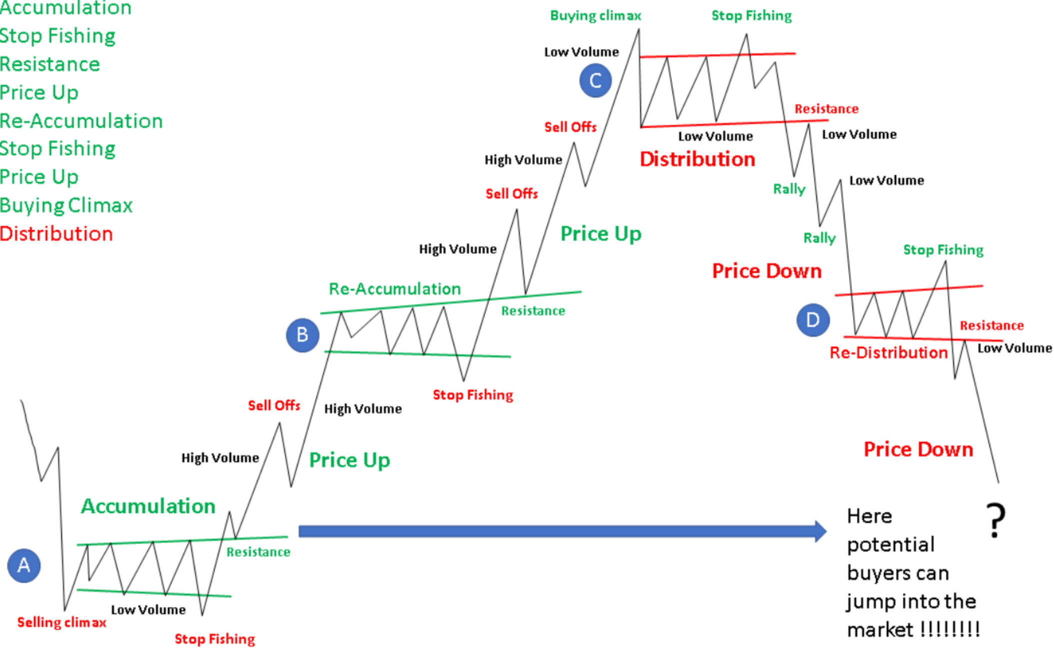
Về mặt tương quan thì thị trường future và spot (giao ngay) có sự liên thông và tương đồng về xu hướng thị trường, do đó ta có thể lấy khối lượng sàn future để phân tích cho spot.

Cách phân tích thì ad đưa ra - anh chị em nếu không hiểu thì xem lại các bài trước.

Cách thức phân tích để ra quyết định giao dịch ad minh họa trên hình đính kèm.

- TIP 1: xác định xu hướng bằng cach kẻ trendline và các mức càn. Đánh dấu khối lượng và cây nến tương ứng. Xác định giá cao / thấp nhất làm điển vao lệnh
- TIP 2: Stoplos tại điêm cao / thấp nhất của cây nến đánh dấu
- TIP 3: Phân tích đa khung thời gian - sau khi đánh dấu chọn chart M1 hoặc M5 để vào lệnh

Chúc anh chị em giao dịch thành công



Distribution
Stop Fishing
Resistance
Price Down
Re-Distribution
Stop Fishing
Price Down
Selling Climax
Accumulation



Currencies

Name	Symbol	Exchange	Maintenance Margin	DayTrade Margin
Australian Dollar	6A	CME/Globex	$1,350.00	$500.00
British Pound	6B	CME/Globex	$2,100.00	$500.00
Canadian Dollar	6C	CME/Globex	$1,000.00	$500.00
EuroFX	6E	CME/Globex	$2,000.00	$500.00
Japanese Yen	6J	CME/Globex	$1,800.00	$500.00
New Zealand Dollar	6N	CME/Globex	$1,200.00	$500.00
Mexican Peso	6M	CME/Globex	$1,750.00	$500.00
Swiss Franc	6S	CME/Globex	$2,800.00	$500.00
E-mini EuroFX	E7	CME/Globex	$1,000.00	$500.00
E-mini Japanese Yen	J7	CME/Globex	$900.00	$500.00
E-micro AUD/USD	M6A	CME/Globex	$135.00	$50.00
E-micro GBP/USD	M6B	CME/Globex	$210.00	$50.00
E-micro USD/CAD	MCD	CME/Globex	$100.00	$50.00
E-micro EUR/USD	M6E	CME/Globex	$200.00	$50.00
E-micro JPY/USD	MJY	CME/Globex	$180.00	$50.00
E-micro CHF/USD	MSF	CME/Globex	$280.00	$50.00
Dollar Index	DX	ICE Futures U.S.	$1,650.00	$500.00

26/9/19

Xin chào các bạn

Sau thời gian bận công việc riêng không có thời gian viết bài và có nhiều bạn nhắn tin Zalo hỏi về volume nên hôm nay nhân có thời gian rảnh ad xin tiếp tục series về cách sử dụng volume theo dấu Bigboy.

Như chúng ta đã biết thị trường ngoại hối là 1 thị trường khổng lồ trên thế giới, nơi giao dịch hàng ngày là trên 5 nghìn tỷ USD và trong đó 95% là hoạt động liên ngân hàng giữa các tổ chức lớn, chính phủ và các ngân hàng hàng đầu, 5% còn lại là giành cho các brokers và retails trader (chúng ta nằm trong số 5% đó). Do đó việc giao dịch forex của retail trader là dự đoán giá để nương theo kiếm lời.

Việc xác định hướng di chuyển của thị trường (trend) là việc cực kỳ khó khăn, thêm nữa việc các sàn làm khó trong quá trình giao dịch là 2 rào cản rất lớn để trader kiếm tiền. Sự thật là 90% trader sẽ bị lỗ hoặc cháy tài khoản không phải do không tìm được setup đẹp mà do cách quản lý tài khoản.

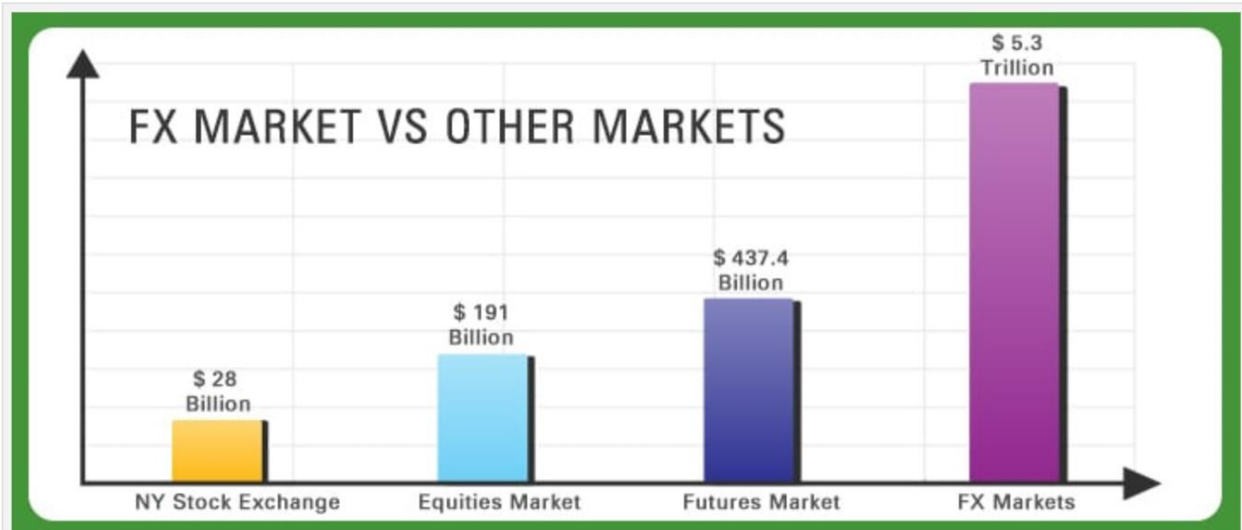
Theo tiết lộ của các trader kỳ cựu có kết quả giao dịch đẹp thì tỷ lệ lệnh giao dịch có setup thành công của họ chỉ khoảng 45 - 55%, còn lại là cách quản lý tài khoản để có lợi nhuận lớn nhất và stoploss nhỏ nhất.

Có nhiều phương pháp để tìm setup giao dịch đẹp, nhưng để setup thành công với lợi nhuận đủ lớn thì lại không nhiều. Do thị trường qua lớn nên các Bigboy cũng giao dịch không nhiều, chủ yếu là họ kiên nhẫn chờ đợi vùng giá thích hợp để đẩy sóng thị trường và dùng chính lực của thị trường để đẩy giá đi xa.

Hôm nay ad sẽ chia sẻ 1 phương pháp kết hợp volume để tìm vùng giá đẹp và cho tỷ lệ thành công cao.

Trên cặp GBPUSD chúng ta thấy giá đã phá vỡ kênh giảm giá, sau khi thiết lập đỉnh cao mới thì giá quay trở lại vùng support để kiểm tra thị trường, thực ra là thị trường không đủ khối lượng để đẩy giá đi tiếp.

Việc hiện tại của chúng ta là theo dõi diễn biến giá, tìm mô hình đảo chiều và xác nhận khối lượng để vào lệnh.
Nên nhớ là setup đẹp phải kèm theo khối lượng đủ lớn để xác nhận xu hướng, và khối lượng này do các Bigboy tạo ra.
Chúc các bạn giao dịch thành công







14/1/20

Serries này ad sẽ viết chi tiết về kỹ thuật phân tích giá - khối lượng. Đây sẽ cung cấp sức mạnh cho trường phái phân tích kỹ thuật trong giao dịch chứng khoán, trái phiếu và ngoại hối

Tổng quan về phân tích giá khối lượng / Price – volume – analysis (PVA)

Nếu Charles Dow là cha đẻ của phân tích kỹ thuật, thì người đương thời của ông, Richard Wyckoff có thể được coi là cha đẻ của phân tích khối lượng và giá cả, ông đã tạo ra các quy tắc của phương pháp mà chúng ta sử dụng ngày nay, Wyckoff nêu ra ba quy luật cơ bản:

1. Quy luật cung cầu

Đây là quy luật đầu tiên và cơ bản của ông, xuất phát từ kinh nghiệm của ông ấy với tư cách là một nhà môi giới với kiến thức chuyên sâu về cách các thị trường phản ứng với diễn biến của hành động giá. Khi cầu lớn hơn cung thì giá sẽ tăng để đáp ứng nhu cầu, và ngược lại khi cung lớn hơn thì cầu sẽ giảm, do cung bị hấp thụ quá mức.

Ví dụ doanh số mùa Sale off cuối năm: giá giảm và số lượng đơn hàng tăng vọt

2. Quy luật nhân quả

Luật thứ hai cho rằng để có kết quả trước tiên phải có nguyên nhân và hơn nữa, hiệu ứng sẽ tỷ lệ thuận với nguyên nhân. Nói cách khác một nỗ lực làm việc nhỏ sẽ chỉ dẫn đến một kết quả nhỏ thu được và ngược lại.

Ví dụ đơn như các con sóng trên biển, một sóng lớn đánh vào tàu sẽ làm tàu rung lắc dữ dội, trong khi đó nếu sóng nhỏ sẽ có ít hoặc không có tác dụng với con tàu.

3. Quy luật nỗ lực phản ánh kết quả

Đây là quy luật thứ ba của Wyckoff, tương tự như định luật vật lý thứ ba của Newton. Mỗi hành động phải có một phản ứng tương đương và ngược lại. Nói cách khác hành động giá trên biểu đồ phải phản ánh hành động khối lượng bên dưới. Cả hai phải luôn hòa hợp với nhau, với nỗ lực nào (khối lượng) sẽ thu được kết quả đó (hành động giá).

Sau đây chúng ta bắt đầu phân tích từng cây nến, sử dụng "phương pháp nội soi", để khám phá liệu luật này có được duy trì hay không. Nếu có, thì thị trường đang hoạt động như bình thường và chúng ta có thể tiếp tục phân tích trên các thanh sau. Nếu có một sự bất thường, thì chúng ta cần khám phá lý do tại sao, và giống như một nhà điều tra hiện trường vụ án, chúng ta phải đi tìm lý do cho hành động của giá.

Các nguyên tắc cơ bản

Nguyên tắc số 1: Nghệ thuật thì không khoa học

Nguyên tắc đầu tiên để hiểu là học cách đọc biểu đồ bằng VPA đó là một môn nghệ thuật, nó không phải là môn khoa học. Hơn nữa, nó không phải là một kỹ thuật dễ dàng cho việc tự động hóa hoặc tạo phần mềm. Mặc dù phải mất một chút thời gian để trở nên thành thạo, nhưng bạn sẽ được đền đáp xứng đáng cho công sức và thời gian của mình. Sau đó nó có thể được áp dụng cho bất kỳ sản phẩm nào trong bất kỳ thị trường nào trong bất kỳ khung thời gian nào. Lý do phần mềm không hoạt động với VPA, đơn giản là hầu hết phân tích là chủ quan. Bạn đang so sánh và phân tích hành vi giá so với khối lượng liên quan, tìm kiếm tín hiệu xác nhận hoặc bất thường, đồng thời so sánh khối lượng để đánh giá điểm mạnh hay điểm yếu của nó trong bối cảnh lịch sử khối lượng.

Ưu điểm khác là một khi bạn đã học được kỹ thuật này bạn có thể sử dụng nó trong mọi thị trường trong suốt quá trình giao dịch của bạn! Chi phí duy nhất là cần tiếp cận bất kỳ nguồn cấp dữ liệu tin cậy nào cần cho khối lượng trực tiếp

Nguyên tắc số 2: Kiên nhẫn

Nguyên tắc này khiến tôi mất một thời gian để tìm hiểu, vì vậy tôi hy vọng rằng tôi có thể tiết kiệm cho bạn một lượng lớn công sức lãng phí ở đây.

Thị trường tài chính giống như một siêu tàu chở dầu. Nó không thể dừng hay chuyển hướng ngay lập tức. Thị trường cũng vậy, nó luôn cần có động lực và sẽ luôn tiếp tục vượt ra ngoài mô hình nến hoặc nến đang báo hiệu một sự đảo ngược tiềm năng hoặc sự bất thường. Khi mới bắt đầu, tôi luôn luôn trở nên rất phấn khích mỗi khi tôi thấy tín hiệu giao dịch và sẽ vào một vị thế ngay lập tức và phần lớn là thua lỗ

Lý do cho điều này rất đơn giản là chúng ta luôn luôn có xu hướng hành động ngay lập tức với những tình huống xảy ra trước mắt và đó là kết quả của việc xử lý thông tin ngay lập tức giữa mắt và não bộ.

Hãy lấy một ví dụ về xu hướng giảm trong đó thị trường đã được bán trong một thời gian của một số nến xuống. Tại thời điểm này, chúng tôi bắt đầu thấy các dấu hiệu lực mua tiềm năng vào thị trường. Những người bán đang bị choáng ngợp bởi những người mua. Tuy nhiên, tất cả chúng KHÔNG bị áp đảo ngay lập tức trong hành động giá của nến. Một số người bán tiếp tục hành động và tin rằng thị trường sẽ giảm xuống nữa. Thị trường di chuyển thấp hơn một chút, nhưng sau đó bắt đầu di chuyển cao hơn và một số người bán thấp hơn sợ hãi ra khỏi thị trường. Thị trường sau đó giảm trở lại thấp hơn một lần nữa, trước khi phục hồi và làm như vậy thị trường đang rung lắc người bán càng cố chấp. Cuối cùng, thị trường đã sẵn sàng để tăng cao hơn khi đã 'dọn dẹp' những khối lượng cuối cùng của việc bán hàng.

Như tôi đã nói trước đây, thị trường không bao giờ ngừng ngay lập tức và đảo ngược. Luôn luôn cần có thời gian để tất cả người bán hoặc tất cả người mua cố chấp được 'dọn dẹp', và điều này diễn ra liên tục tạo ra các vùng giá tắc nghẽn ngang mà chúng ta thường thấy sau khi một xu hướng di chuyển cao hơn hoặc thấp hơn. Đây là nơi mà sự hỗ trợ và kháng cự giá trở nên mạnh mẽ và đó cũng là một yếu tố chính của VPA.

Chúng ta không nên hành động ngay khi có tín hiệu xuất hiện. Bất kỳ tín hiệu nào chỉ là dấu hiệu cảnh báo về sự thay đổi sắp xảy ra và chúng ta hãy kiên nhẫn. Trước khi cơn mưa tạnh, nó không ngừng rơi ngay, mà nó dần dần ngớt, rồi dừng lại. Khi bạn làm đổ thứ gì đó và phải lau với một số giấy thấm, 'nhát lau đầu tiên' sẽ thu dọn phần lớn chất bị đổ, nhưng phải mất vài lần lau để hoàn thành công việc.

Hãy tưởng tượng thị trường là một miếng bọt biển. Phải mất thời gian để hoàn thành thao tác lau dọn, trước khi nó sẵn sàng để di chuyển.

Tôi hy vọng tôi đã đưa ra quan điểm! Hãy kiên nhẫn và chờ đợi. Sự đảo ngược sẽ đến, nhưng không phải ngay lập tức từ một tín hiệu trên một ngọn nến.

Nguyên tắc số 3: Tất cả đều tương đối

Việc phân tích khối lượng hoàn toàn tương đối và tôi chỉ đi đến kết luận này một khi tôi ngừng ám ảnh về nguồn cấp dữ liệu của mình. Khi mới bắt đầu, tôi cố gắng hiểu mọi khía cạnh của nguồn cấp dữ liệu, nó từ đâu đến? dữ liệu được thu thập như thế nào? nó có chính xác? Làm thế nào để so sánh với các nguồn cấp dữ liệu khác? Và có một cái gì đó tốt hơn sẽ cho tôi tín hiệu chính xác hơn, v.v. Cuộc tranh luận này tiếp tục cho đến ngày nay trên nhiều diễn đàn giao dịch với các cuộc thảo luận xoay quanh nguồn gốc của dữ liệu.

Sau khi trải qua nhiều tháng cố gắng để so sánh các nguồn cấp dữ liệu và kiểm tra lại, tôi sớm nhận ra rằng KHÔNG CÓ gì cần phải lo lắng về sự không hoàn hảo nhỏ hoặc sự khác biệt.

Như tôi đã viết trước đó, giao dịch và PVA là một nghệ thuật, không phải là môn khoa học.

Nguồn cấp dữ liệu sẽ thay đổi từ các nhà môi giới khác nhau do đó tạo ra các mô hình nến hơi khác nhau.

Nếu bạn so sánh biểu đồ từ một nhà môi giới này với một nhà môi giới khác cùng 1 sản phẩm và khung thời gian, thì rất có thể bạn sẽ có hai cây nến khác nhau. Và lý do cho điều này là rất đơn giản bởi vì việc đóng nến sẽ phụ thuộc vào nhiều thứ khác nhau, nhất là tốc độ đồng hồ trên máy tính của bạn, nơi bạn đang ở trên thế giới và tại thời gian nào trong phiên, giá đóng cửa được kích hoạt. Tất cả đều khác nhau.

Nguồn cấp dữ liệu rất phức tạp trong cách họ tính toán và trình bày dữ liệu cho bạn trên màn hình. Tất cả đều đến từ các nguồn khác nhau và được quản lý những cách khác nhau.

Khối lượng là tương đối, vì vậy nó không có sự khác biệt miễn là bạn đang sử dụng cùng một nguồn cấp dữ liệu mọi lúc.

Đây là lý do tại sao tôi không tranh cãi với ai đó nói rằng khối lượng đánh dấu (tick volume) là đại diện cho khối lượng chỉ chính xác 90%. Vậy thì sao? Đối với tôi nó có thể chính xác 70% hoặc 80%. Tôi không quan tâm đến "độ chính xác". Tất cả tôi quan tâm là sự nhất quán. Miễn là data phù hợp thì tốt, bởi vì tôi đang so sánh thanh khối lượng của mình trên nguồn cấp dữ liệu của mình với các thanh khối lượng trước đó trên cùng nguồn cấp dữ liệu của tôi! Tôi không so sánh nó với data của người khác. Tôi thừa nhận đã mất thời gian trước khi tôi nhận ra rằng cách tiếp cận thông thường này là hoàn toàn hợp lệ.

Vì vậy, xin đừng lãng phí nhiều thời gian như tôi đã làm. Khối lượng hoàn toàn tương đối vì chúng ta liên tục so sánh một thanh khối lượng này với thanh khác và đánh giá xem liệu nó cao, thấp hay trung bình với những gì đã đi trước đó. Nếu dữ liệu không hoàn hảo, thì nó không có gì khác biệt, như tôi đã nói tôi không so sánh các dữ liệu không hoàn hảo với nhau.

Lập luận tương tự áp dụng cho khối lượng đánh dấu trong thị trường ngoại hối giao ngay. Tôi chấp nhận nó không hoàn hảo một lần nữa, nhưng chúng tôi chỉ so sánh thanh này với thanh khác và miễn là nó hiển thị hoạt động, điều đó là tốt. Đó là một thế giới không hoàn hảo và là một thế giới chúng ta phải sống và giao dịch.

Nền tảng MT4 hoạt động hoàn hảo - hãy tin tôi. Tôi đã sử dụng nó trong nhiều năm và kiếm tiền mỗi ngày bằng cách sử dụng nó. Hơn nữa, nó được cung cấp, miễn phí bởi nhà môi giới

Nguyên tắc số 4: Thực hành cho hoàn hảo

Cần có thời gian để thành thạo bất kỳ kỹ năng nào, một khi đã trải nghiệm thực tế thì không bao giờ bị lãng quên. Các kỹ thuật giao dịch bạn học được sẽ hoạt động mọi lúc, tại các khung thời gian và có giá trị như nhau, cho dù bạn là nhà đầu cơ hay nhà đầu tư. Là một nhà đầu tư, bạn có thể đang tìm mua và nắm giữ trong nhiều tháng, vì vậy sẽ xem xét các biểu đồ dài hạn như ngày và tuần. Ngoài ra, bạn có thể là một nhà giao dịch trong ngày sử dụng VPA trên biểu đồ tick

hoặc biểu đồ phút hoặc giờ. Vì vậy, hãy dành thời gian của bạn và đừng nôn nóng. Đó là giá trị thời gian và công sức bạn đầu tư, và sau một vài vài tuần hoặc vài tháng bạn sẽ ngạc nhiên về việc bạn có thể đột nhiên bắt đầu diễn giải và dự báo mọi biến động trên thị trường nhanh đến mức nào.

Nguyên tắc số 5: Phân tích kỹ thuật

PVA chỉ là một phần của câu chuyện. Chúng tôi luôn sử dụng nhiều kỹ thuật khác để xác nhận mẫu và cung cấp xác nhận bổ sung. Quan trọng nhất trong số này là hỗ trợ và kháng cự. Đây là lúc thị trường tạm dừng và thực hiện hoạt động 'dọn dẹp', trước khi đảo ngược, hoặc đó là một điểm tạm dừng trong một xu hướng dài hạn hơn, sau đó sẽ được xác nhận bởi phân tích khối lượng. Một đột phá từ một trong những khu vực hợp nhất này cùng với khối lượng luôn là một tín hiệu mạnh mẽ.

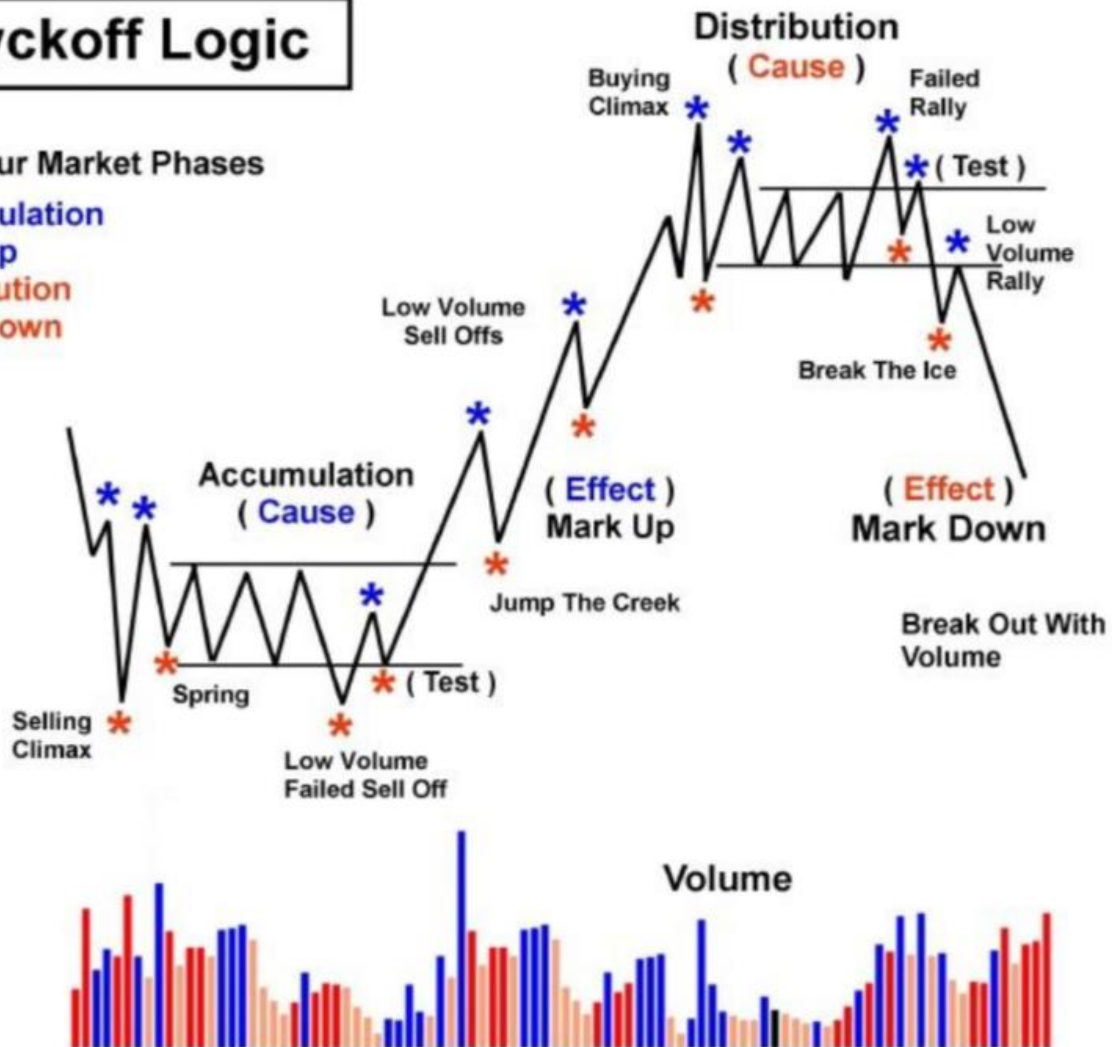
Xu hướng cũng quan trọng không kém, như phân tích mô hình giá, tất cả các phần của phân tích kỹ thuật là một nghệ thuật.

Nguyên tắc số 6: Xác nhận hoặc bất thường

Khi sử dụng PVA làm phương pháp phân tích, chúng ta chỉ tìm kiếm hai điều: xu hướng tiếp tục được xác nhận bởi khối lượng, hoặc liệu có bất thường với giá.

Nếu mô hình giá được xác nhận bởi khối lượng thì điều đó xác nhận tiếp tục hành vi giá. Ngược lại nếu mô hình giá có sự bất thường của khối lượng, thì điều này đang gửi tín hiệu về một sự thay đổi tiềm năng. Đây là những điều duy nhất chúng ta liên tục tìm kiếm trong PVA.

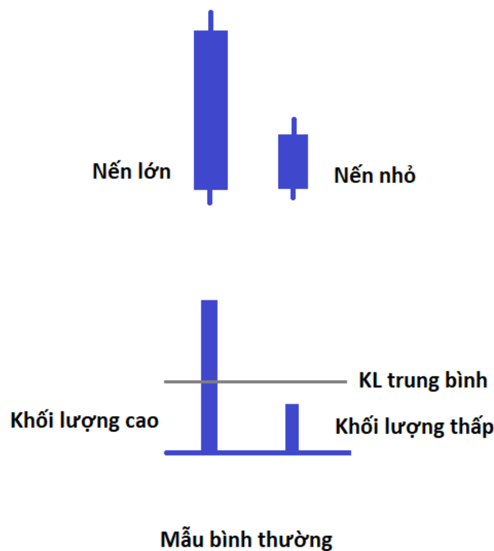
Bài viết sẽ tiếp tục ở các phần sau



15/1/20

Tiếp theo chúng ta sẽ xem xét các mẫu nến - khối lượng bình thường và bất thường khi tiến hành phân tích PVA trên đồ thị.
I. Mô hình xác nhận (bình thường)
Theo quy luật số 3 của Wyckoff (nỗ lực phản ánh kết quả), với khối lượng thấp thì mức giá đạt được cũng nhỏ và ngược lại nỗ lực lớn sẽ cho giá di chuyển lớn. Đây sẽ là hợp lệ khi chúng ta xem xét ở mọi khía cạnh của cuộc sống một cách bình thường
II. Mô hình bất thường
Với mô hình bất thường thì nó đi ngược lại quy tắc số 3 của Wyckoff. Điều này báo hiệu một hoạt động bất hợp lý trên thị trường, nó cảnh báo cho chúng ta biết có gì đó không ổn và thị trường đang yếu tại thời điểm hiện tại. Thị trường đi tiếp hay quay đầu chúng ta còn phải xét thêm nhiều yếu tố khác.
Tín hiệu này cho chúng ta thấy các chuyên gia - nhà tạo lập thị trường dường như đứng ngoài hay đang thu thập khối lượng ngược lại hướng đi của giá, có thể họ đang chốt lời hoặc tích lũy khối lượng để đẩy giá quay đầu.

Hãy tưởng tượng tới cảnh tượng một người bị khiếm thị đang tìm đường để đi, họ thường sử dụng cây gậy để dò đường. Nếu để một người khiếm thị tự đi mà không có công cụ hỗ trợ (cây gậy) họ sẽ rất khó khăn để xác định đúng hướng, nhưng nếu ta trao cho họ cây gậy họ sẽ dễ dàng hơn để tìm đường . Họ thường có đôi tai và mũi rất nhạy và khả năng ghi nhớ rất tốt các mùi vị, âm thanh và vị trí trên các khung đường quen thuộc.
Với trader chúng ta cũng vậy, chúng ta không phải vị thế là chuyên gia ngân hàng, nhà tạo lập thị trường, chúng ta không thể nhìn thấy vị thế thực tế hiện tại của thị trường, chúng ta giống như những người khiếm thị đang lần mò hướng đi của giá. Chúng ta thường bị hành động giá tác động vào hành động bản thân, đó là điều bình thường vì phần lớn trader chỉ nhìn thấy giá, trong khi để giá di chuyển thì cần phải tác động bằng khối lượng - cái này chúng ta không có thế mạnh bằng các chuyên gia.
Hãy chấp nhận thực tế rằng, thị trường là rất lớn nó như 1 con tàu chở dầu khổng lồ, nếu muốn con tàu dừng lại hoặc đổi hướng nó cần thời gian và động lực từ bộ máy khổng lồ, nó không thể bật nhảy lanh lẹ như việc ta tung đồng xu xuống sàn nhà.
Như các bài trước tôi đã nói là bogboy, bigplayer hoặc ngân hàng là các tổ chức lớn, chinh họ mới đủ động lực để lái giá đi theo ý muốn của họ. Họ vừa là nhà tạo lập thị trường, vừa là trọng tài nên họ có vị thế rất đặc biệt trên thị trường, chúng ta là trader nhỏ lẻ không thể đòi hỏi những ưu thế đó.
Họ có thể lái giá, vẽ chart để thu hút các nhà giao dịch tham gia vào trò chơi của họ, họ có thể sử dụng rất nhiều đại lý tham gia vào cuộc chơi để chia nhỏ khối lượng tránh bị phát hiện. Nhưng dù cho họ giấu mình kín thế nào thì gót chân Achille vẫn bị lộ ra với khối lượng, khối lượng là rất khó che giấu.
Với các nhà giao dịch sử dụng các công cụ - indicator dựa trên giá thì thường sẽ có độ trễ nhất định và thường nhảy vào thị trường khi mọi thứ đã quá rõ ràng, thực tế thì đây lại là thời điểm các chuyên gia lợi dụng khối lượng lớn để chốt lời hoặc tích lũy khối lượng để chuẩn bị lái giá quay trở lại.
Với các nhà giao dịch phân tích hành động giá mà không sử dụng khối lượng thì độ trễ cũng tương đương, đôi khi chuyên gia vẽ chart làm cho họ dễ bị lầm tưởng khi chỉ tin vào giá.
Phân tích giá - khối lượng không phải chén thánh, nhưng nó cung cấp cho ta cái nhìn sâu hơn trong từng hành động giá, nó giúp cho việc phân tích kỹ thuật tránh được các rủi ro khi nhà giao dịch quyết định tham gia hay đứng ngoài tại mức giá đó.
Xin nhắc lại nếu bạn có ý định tham gia vào 1 trạng thái giao dịch thì hãy lưu ý tới hành động của khối lượng trên thị trường. Thà rằng không kiếm được tiền hôm nay nhưng ta vẫn còn vốn để tìm kiếm lợi nhuận trong tương lai.
Hãy nhớ nằm lòng 3 quy luật và 6 nguyên tắc trước, để tránh các rủi ro kinh điển : mua đỉnh, bán đáy
Trong các bài viết sau tôi sẽ cung cấp cho các bạn các mẫu nến - khối lượng mà chúng ta thường gặp trên thị trường.

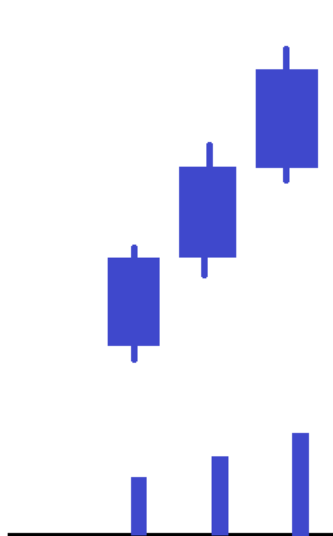


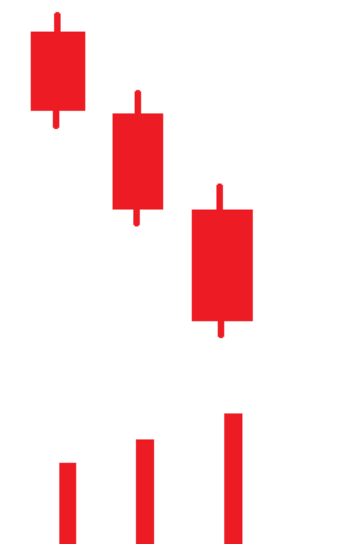
18/1/20

Tiếp theo serries tôi muốn giải thích cách chúng ta sử dụng VPA với cụm nến và khối lượng, để xác định rằng: khối lượng xác nhận hành động giá, hay đây là một sự bất thường?
Trong hình minh họa chúng ta có một xu hướng tăng và giảm đi kèm với khối lượng tăng. Đây chính xác là những gì chúng ta mong đợi sẽ thấy và hơn nữa việc có nhiều thanh khối lượng cũng cho chúng ta một cái nhìn tỏng quát tốt hơn, dựa vào đó để đánh giá xu hướng tiếp theo
Đây là những gì chúng ta sẽ thấy xảy ra trên biểu đồ khi phân tích. Cây nến mở đầu nhỏ với khối lượng thấp, khối lượng xác nhận giá, không có bất thường ở đây. Cây nến thứ hai sau đó bắt đầu hình thành và đóng lại với nến và khối lượng cao hơn một chút. Lưu ý rằng mức độ phát triển của nến và khối lượng lớn hơn lần đầu tiên và dựa trên quy tắc của Wyckoff cho ta thấy xu hướng tăng là hợp lệ, khối lượng đã xác nhận giá trên cả hai nến.
Vào thời điểm cây nến thứ ba bắt đầu hình thành và đóng lại với mức chênh lệch lớn hơn cả cây thứ nhất và thứ hai, chúng ta sẽ mong đợi một thanh khối lượng phản ánh quy luật thứ ba của Wyckoff: nỗ lực phản ánh với kết quả.
Do đó, một lần nữa, hành động giá trên nến đã được xác nhận bởi khối lượng. Nhưng, ngoài sự quan sát đơn giản đó, ba cây nến hiện đang xác thực xu hướng giá cả.
Nói cách khác, giá trên ba cây nến đã tăng cao hơn, phát triển thành một xu hướng và khối lượng đang tăng lên và xác nhận xu hướng lên.
Xét cho cùng, giống như nỗ lực phản ánh kết quả áp dụng trên một cây nến, nó cũng áp dụng cho một "xu hướng" mà trong trường hợp này bao gồm nhiều cây nến. Do đó, nếu giá di chuyển xa hơn trong xu hướng thì theo quy luật thứ ba của Wyckoff, chúng ta cũng sẽ thấy khối lượng tăng lên.
Quy luật thứ 3 này không chỉ áp dụng cho từng nến riêng lẻ chúng ta đã xem xét trước đó, mà còn áp dụng cho các xu hướng bắt đầu được xây dựng, khi chúng ta đặt những ngọn nến cùng nhau.
Nói cách khác, chúng ta có hai cấp độ xác nhận (hoặc bất thường).
Mức đầu tiên dựa trên mối quan hệ giá / khối lượng trên từng cây nến. Mức thứ hai dựa trên mối quan hệ giá / khối lượng của một nhóm nến, sau đó bắt đầu xác định xu hướng. Đây là trường hợp thứ hai nơi luật nhân quả của Wyckoff có thể được áp dụng. Ở đây mức độ ảnh hưởng (thay

đổi giá theo xu hướng) sẽ liên quan đến quy mô của nguyên nhân (khối lượng và thời gian áp dụng).
Trong ví dụ này chúng ta có một bức tranh đơn giản, hành động giá trên mỗi cây nến đã được xác thực với khối lượng liên quan và tổng thể hành động giá đã được xác nhận bởi khối lượng tổng thể. Tất cả điều này có thể được tóm tắt là giá tăng = khối lượng tăng. Nếu thị trường đang tăng và chúng tôi thấy khối lượng tăng liên quan đến việc di chuyển, thì đây là một động thái hợp lệ cao hơn, được hỗ trợ bởi tâm lý thị trường và market maker. Nói cách khác, các chuyên gia và market maker đang tham gia di chuyển thị trường và chúng tôi thấy điều này được phản ánh trong việc tương đồng giữa giá và khối lượng.

khung thời gian tùy thuộc vào balance và phong cách trade. Mình thì giao dịch intraday nên xét 3 khung, M30, M15, M5.
#Grabtrader , #volumetrader





Nến - khối lượng xác nhận thị trường tăng

Nến - khối lượng xác nhận thị trường giảm

5/6
Chào các anh chị em, trước khi tiếp tục serries về phân tích khối lượng thị trường, ad muốn mô tả lại bức tranh thị trường để mọi người hiểu đúng đắn về phương pháp này mới mong có thể giao dịch thành công.
Để hiểu đúng về khối lượng tham gia thị trường chúng ta cần nhìn kỹ mô tả đơn giản cách vận hành của thị trường trong hình đính kèm.
Thị trường bình thường được vận hành bởi các nhà tạo lập thị trường (các ngân hàng, quỹ đầu tư lớn đa quốc gia, các quỹ phòng hộ thị trường, các tập đoàn lớn .. cuối cùng là các nhà đầu tư nhỏ lẻ). Khi thị trường bị sốc (giá quá cao hoặc quá thấp thì các ngân hàng trung ương sẽ can thiệp bằng các chính sách: lãi suất, gói hỗ trợ, hoặc can thiệp trực tiếp ....

Với các thông tin về khối lượng trên thị trường (chứng khoán, hàng hóa, tương lai ..) trên thị trường tập trung như NASDAQ, DJ, CME, CBOT, EURNEX, LSE ... thì đó là con số chúng ta thấy trên các cửa sổ đặt lệnh (Book) của các lệnh chờ (limit, stop)
Còn trên biểu đồ của khách hàng phần cột bên dưới thể hiện tổng khối lượng mua bán đã hoàn thành trong 1 khoảng thời gian nhất định.
Giá trên biểu đồ là thể hiện hiện tại ở mức giá đó cả bên mua và bên bán đều hài lòng và cân bằng về khối lượng. Khi thị trường di chuyển thì đó là do nhu cầu của 1 bên vượt trội bên kia và thị trường mất cân bằng. Nếu bên mua chiếm ưu thế thì tại thời điểm đó thị trường thiếu khối lượng bán và du mua và buộc nó phải di chuyển cao hơn, nơi có khối lượng lớn hơn đang chào bán, nếu không đủ nhu cầu khối lướng từ bên mua thì giá lại tiếp tục leo cao, cứ như vậy giá di chuyển cao hơn, tới khi thị trương lấy lại được cân bằng khối lượng thì giá sẽ dừng lại. Ngược lại với giá xuống.
Phân tích khối lượng thị trường cần đòi hỏi chúng ta phải biết phân tích bối cảnh và cấu trúc thị trường hiện tại đang ở kịch bản tăng hay giảm giá bằng cách phân tích biểu đồ các khung thời gian lớn như: biểu đồ tháng, tuần, ngày để có cái nhìn toàn cảnh thị trường ví dụ như biểu đồ đính kèm
Volume mà trader thấy chỉ chóp nổi của tảng băng trôi, còn khối lượng ngầm của các lệnh lớn được chia nhỏ nó mới quyết định hướng đi của thị trường. Nếu chỉ phân tích volume thì không ổn mà còn phải coi cấu trúc và bối cảnh thị trường. Còn nữa là data bạn nhận về nó có chính xác hay không. Mình thì mua data của CQG và thuê phần mềm chuyên về volume
Phiên Á nếu không có tin của AU, NZ, J thì mình ko quan tâm lắm, chủ yếu nó là phiên tích lũy cho phiên Âu. Mình chỉ giao dịch đầu phiên Âu và đầu phiên Mỹ



Bức tranh cơ bản của thị trường

14/6

Chào các anh chị em.
Chúng ta lại tiếp tục series về nến và khối lượng, lần này chúng ta sẽ phân tích về các cảnh báo của thị trường trong mô hình dị thường giữa nến và khối lượng trong xu hướng tăng. Các anh chị

em hãy xem kỹ hình minh họa và hãy thực hành cho kỹ, tới đây chúng ta mới đi được một nửa về serries này. Bài phân tích khá dài anh chị em kiên nhẫn đọc cho hết

Ví dụ trong hình chúng ta có thị trường dường như là một xu hướng tăng với nến nhỏ đầu tiên đi kèm với khối lượng tương đối nhỏ. Điều này là tốt vì khối lượng đang xác nhận giá. Cây nến thứ hai hình thành sau đó và chúng ta có một cây nến lớn hơn một chút so với đầu tiên cùng với khối lượng cao hơn.

Hãy nhìn lại các thanh trước đây, điều này dường như là một sự bất thường. Với khối lượng lớn, chúng ta hy vọng sẽ thấy một cây nến lớn, thay vào đó chúng ta chỉ có một cây nến cao hơn một chút so với cây nến trước đó, vì vậy có gì đó không đúng ở đây - một cảnh báo vang lên!

Hãy nhớ quy luật thứ ba của Wyckoff: nỗ lực phản ánh kết quả? Ở đây, nỗ lực (khối lượng) không dẫn đến kết quả chính xác (giá cả), vì vậy chúng ta thấy có sự bất thường trên một cây nến, có thể là tín hiệu cảnh báo sớm bắt đầu vang lên!

Cây nến thứ ba sau đó hình thành và đóng lại cao hơn nhưng với khối lượng thấp hơn so với cây nến trước đó, theo nguyên tắc trên thì cây nến phải cao hơn không thấp hơn. Một tín hiệu cảnh báo khác.

Cây nến thứ tư sau đó hình thành và đóng cửa khi giá tăng cao hơn nhưng khối lượng thậm chí còn thấp hơn!

Bây giờ chúng ta đang có một số dị thường trên các cây nến hai, ba và bốn.

Nến dị thường 2

Đây là một sự bất thường, chúng ta có một mức chênh lệch nhỏ về giá nhưng khối lượng cao, thị trường chỉ tăng 1 khoảng nhỏ với những nỗ lực lớn của khối lượng. Điều này đang báo hiệu sự yếu kém tiềm năng, đáng lẽ giá phải tăng lên cao sau nỗ lực của khối lượng. Có thể các nhà tạo lập thị trường đang bán ra ở cấp độ này! Đó là dấu hiệu đầu tiên của một động thái của những người trong cuộc.

Nến 3 - hai lần dị thường!

Ở đây có hai bất thường trong một cây nến. Thứ nhất, mức chênh lệch giá cao hơn so với nến trước, nhưng khối lượng thấp hơn - Áp lực mua đang cạn kiệt.

Thứ hai, chúng ta có một thị trường đang tăng, nhưng khối lượng đã giảm trên cây nến này, thị trường tăng nên được kết hợp với khối lượng tăng, KHÔNG nên kết hợp với khối lượng giảm. Điều này cũng báo hiệu rõ ràng rằng khối lượng trước đó cũng là một sự bất thường (thêm bằng chứng xác nhận).

Nến 4 hai lần dị thường!

Một lần nữa, chúng ta có hai sự bất thường trong một và đang thêm xác nhận rằng khối lượng và giá cả trên xu hướng này không còn nằm trong cùng một thỏa thuận. Thứ nhất ở đây chúng ta có một cây nến tăng giá lớn, nhưng khối lượng của nó thậm chí còn thấp hơn so với các cây nến trước đó trong xu hướng. Theo quy tắc nỗ lực và kết quả, chúng ta mong đợi để có khối lượng cao hơn đáng kể, nhưng thay vào đó chúng ta có khối lượng thấp.

Thứ hai, khối lượng giảm đang xác nhận rằng chúng ta có sự bất thường về xu hướng, vì chúng ta hy vọng sẽ thấy khối lượng tăng với xu hướng tăng, trong khi ở đây chúng ta có khối lượng giảm trên một xu hướng tăng. Tiếng chuông cảnh báo đã vang lên và rõ ràng.

Những kết luận chúng ta có thể rút ra từ bốn cây nến này là gì? Bắt đầu với nến hai, ở đây có nỗ lực, nhưng không dẫn đến các hành động giá tương đương. Do đó, đây là dấu hiệu đầu tiên của sự kiệt sức có thể xảy ra. Thị trường đang xảy ra hiện tượng được gọi là "quá mua".

Các nhà tạo lập thị trường và các chuyên gia đang bắt đầu hoạt động ở đây. Những người bán đang di chuyển vào thị trường khi họ nhận thấy một cơ hội để rút lợi nhuận.

Điều này tạo ra sự kháng cự với giá cao hơn ở mức này, sau đó được xác nhận trên nến thứ ba và thứ tư, nơi khối lượng đang giảm dần.

Các nhà tạo lập thị trường đã nhìn thấy điểm yếu này và đang bán hết mình ở cấp độ này, chuẩn bị cho một động thái giảm giá tiếp theo. Nhưng cây nến tiếp tục được đẩy giá cao hơn để tạo ra cảm giác rằng thị trường vẫn còn tăng. Nhưng không phải vậy, đây chỉ có thể là một sự điều chỉnh tạm thời, không phải là một thay đổi lớn trong xu hướng, nó là một cảnh báo về sự yếu kém tiềm năng trên thị trường.

Khối lượng lớn kèm giá gia tăng thấp là kết quả của việc ngày càng nhiều người bán đóng cửa vị trí của họ và lấy lợi nhuận ra khỏi thị trường, trong khi những người mua còn lại không có đủ động lực để đưa thị trường lên cao hơn. Các nhà tạo lập thị trường cũng đang bán ra ở cấp độ này làm tăng thêm khối lượng, như họ đã thấy sự yếu kém trên thị trường.

Đây là lý do mà khối lượng tiếp tục giảm vào hai cây nến tiếp theo, họ để trader nhỏ lẻ , những người mới vào đẩy trường cao hơn, nhưng họ không còn tham gia vào việc di chuyển. Họ đã rút tiền và đang nhốt các người mới và trader vào các vị trí bất lợi.

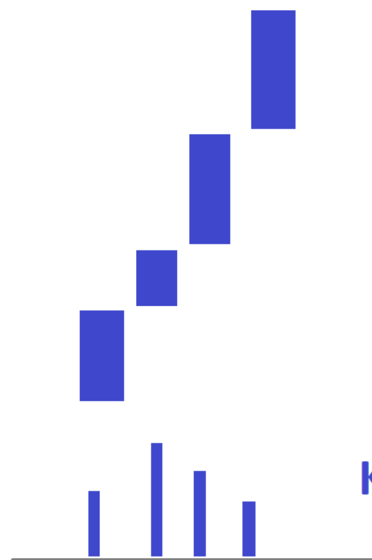
Điểm yếu ban đầu xuất hiện trên nến hai, sau đó được xác nhận rõ ràng hơn bởi nến thứ ba và thứ tư.

Đây thường là chuỗi các sự kiện có sự liên quan tới nhau. Ban đầu chúng ta thấy một sự bất thường xuất hiện bằng cách sử dụng phân tích nến duy nhất. Sau đó chúng tôi thấy những ngọn nến tiếp theo xuất hiện và chúng chống lại dị thường ban đầu. Trong trường hợp này sự bất thường đã được xác nhận, với giá tiếp tục tăng khi khối lượng giảm.

Bây giờ chúng ta đang có một bức tranh thị trường rõ ràng, được xác nhận là đang yếu. Bước tiếp theo là chuyển đến cấp độ cuối cùng trong phân tích, đó là xem xét các phân tích trong bối cảnh lớn hơn trên biểu đồ. Điều này sẽ xác định xem những gì chúng ta đang thấy là một sự điều chỉnh nhỏ hay dẫn đến một thay đổi xu hướng lớn.

Đây là nơi quy tắc thứ hai của Wyckoff có hiệu lực, luật nhân quả. Nếu đây chỉ đơn giản là một sự điều chỉnh hoặc đảo ngược nhỏ, thì nguyên nhân sẽ nhỏ và hiệu quả sẽ nhỏ

Trên thực tế, sự bất thường mà chúng ta đã thấy ở đây, có thể đủ để dẫn đến sự điều chỉnh nhỏ trong thời gian ngắn. Tiếp theo chúng ta sẽ tìm hiểu về xu hướng giảm với nhiều thanh khối lượng dị thường - nó ngược lại với các phân tích trên



14/6

Nay rảnh rồi mình lại tiếp tục phân tích tiếp phương pháp sử dụng khối lượng trong giao dịch sao cho có lợi nhất.

Xin nhắc lại là tất cả các phân tích khối lượng tôi đều sử dụng số liệu từ CME cho thị trường tương lai nên nếu các anh chị em áp dụng trong giao dịch spot có thể nó không chính xác, nhưng nếu anh chị em nghiên cứu kỹ cách thức áp dụng thì vẫn có cơ hội kiếm lợi nhuận.

Như trong hình đính kèm tôi phân tích trên mã GC1! - tức hợp đồng vàng tương lai, mỗi hợp đồng tiêu chuẩn tương đương 100 oz.

Trên hình minh họa cho thấy áp lực bán ở chart H1 đang mạnh dần và mức 1730 bị phá vỡ thì chính thức xác nhận giá sẽ tiếp tục nằm trong kênh giảm về 1670. Qua tuần tới chúng ta cần theo dõi biến động của chỉ số USD trong rổ tiền tệ để có cái nhin dài hạn



20/6

Tiếp theo chúng ta sẽ tìm hiểu về từng giai đoạn tích lũy của thị trường và cách mà các nhà tạo lập thị trường (Bigplayers) hành động

Mô hình giai đoạn tích lũy (xem hinh)

Giai đoạn tích lũy hay còn gọi là khu vực gom mua của Bigplayers – khu vực này có đặc điểm là giá di chuyển trong biên độ hẹp trọng 1 thời gian dài. Lý do là các nhà tạo lập thị trường mong muốn mua được nhiều hàng nhất trong 1 khoảng thời gian với mức giá phù hợp nhất có thể mà không làm thị trường xáo động. Khi họ mua gom đủ nhu cầu thì họ sẽ tìm cách để đánh tiếng cho toàn thị trường biết về nhu cầu dựa trên việc phát hành tin tức hoặc các phân tích của các chuyên gia … Khi đó cả thị trường sẽ bị dẫn dắt bởi các luồng thông tin có lợi cho vị thế của họ với các khối lượng mua mới ào vào thị trường làm cho giá leo lên cao. Ngoài ra họ còn sử dụng thủ thuật câu giá với các khối lượng chờ mua – bán lớn để kéo giá lên theo ý muốn

Các mô hình giá trong giai đoạn tích lũy thường có dạng: hai – ba đáy, vai đầu vai ngược, fake key, bear trap, Doji, morning star ….. Các mô hình giá này thường đi kèm với các mô hình khối lượng dị thường.

Cao trào mua (Buying Climax) - xem hình
Trong giai đoạn tích lũy sau khi Bigplayers lấp đầy giỏ hàng với giá tốt thì họ sẽ cố gắng loại bỏ hết người bán ra khỏi thị trường bằng cách tạo các đợt xung động giá xuống mạnh và nhanh thậm chí thấp hơn cả mức thấp của vùng tích lũy để loại bỏ những người bán còn kiên trì trên thị trường. Khi giá biến động nhanh và mạnh thì người bán sẽ bị chi phối bởi tâm lý FOMO (fear of missing out) - sợ bị lỡ cơ hội và bắt đầu ào ạt bán ra với khối lượng lớn và BB nhanh chóng gom tiếp hàng giá rẻ, sau đó BB nhanh chóng đưa giá trở lại để kiểm tra nguồn cung bằng kỹ thuật câu giá (sẽ có bài phân tích kỹ thuật này) để xác định xem thị trường đã sẵn sàng di chuyển lên mức cao hơn. Người bán bị nhốt tại các vị trí bất lợi nên khi giá di chuyển cao hơn họ sẽ phải đặt lệnh chốt lỗ (stop) tại vùng giá cao, khi giá tiếp cận sẽ kích hoạt hàng loạt lệnh Buy và đẩy thị trường lên mức giá mới vượt khỏi vùng tích lũy theo đúng ý muốn của Bigplayers
Kiểm tra nguồn cung (Testing) - xem hình
Một trong những vấn đề lớn nhất mà các nhà tạo lập thị trường (Bigplayers) gặp phải khi thực hiện chiến dịch tăng giá là họ không bao giờ có thể chắc chắn rằng tất cả khối lượng bán đã bị hấp thụ trong giai đoạn tích lũy.
Điều tồi tệ nhất có thể xảy ra là khi Bigplayers muốn thoát ra khỏi khu vực tích lũy và bắt đầu chiến dịch đẩy thị trường lên cao hơn, thì gặp những khối lượng bán lớn còn sót lại và thị trường bị đẩy giá xuống thấp hơn, nó làm thất bại công việc khó khăn nhất là đẩy hết khối lượng bán của trader ra khỏi thị trường.
Làm thế nào để Bigplayers vượt qua vấn đề này? Câu trả lời là cũng giống như ở bất kỳ thị trường nào khác, họ cần kiểm tra nguồn cung!
Điều này không khác gì khởi động một chiến dịch tiếp thị để bán một kho chứa đầy hàng hóa. Không chỉ các mặt hàng phải được định giá chính xác, mà nó cần thị trường sẵn sàng tiếp thu. Do đó, một thử nghiệm nhỏ được sử dụng để xác nhận xem họ có quyền bán sản phẩm đó với mức giá cao, và họ cũng chuẩn bị thông điệp tiếp thị phù hợp để bán với số lượng lớn.
Sau khi Bigplayers đã hoàn thành giai đoạn tích lũy, họ đưa thị trường lên cao hơn một chút để bắt đầu quá trình bán hàng. Trước khi đẩy giá lên cao để bán, họ thực hiện một thử nghiệm để đánh giá phản ứng thị trường và kiểm tra xem tất cả khối lượng bán đã được hấp thụ hết trong giai đoạn tích lũy hay chưa.
Kiểm tra với khối lượng thấp - Tin tốt !! - xem hình
Giai đoạn giá mà chúng ta đang xem xét ở đây nằm trong giai đoạn tích lũy trước đó, nơi mà Bigplayers đã làm thị trường sụt giá nhanh chóng, nó khiến mọi người sợ hãi và bán hoảng loạn với khối lượng lớn trong khu vực này. Bigplayers bắt đầu rung chuyển thị trường nhiều hơn để cố loại bỏ những trader giữ khối lượng mua trước khi họ dần dần đẩy thị trường ra khỏi khu vực này và bắt đầu xu hướng tăng nhẹ nhàng, cuối cùng sẽ phát triển mạnh vào giai đoạn phân phối ở đỉnh của xu hướng tăng.
Tại thời điểm này, Bigplayers đang đưa thị trường trở lại khu vực bán mạnh gần đây, điều tồi tệ nhất có thể xảy ra là nó gặp áp lực bán lớn còn trong thị trường đẩy giá thấp trở lại, gây khó khăn cho việc đưa thị trường khỏi khu vực tích lũy.
Từ khu vực biên giá cao trong giai đoạn tích lũy, Bigplayer có thể lợi dụng một mục nhỏ của tin xấu để đẩy thị trường xuống thấp, để kiểm tra xem liệu điều này có khả năng tìm ra người bán còn lại nào không? Nếu khối lượng bán thấp, điều này ngay lập tức cho Bigplayers biết rằng có rất ít người bán còn lại và hầu như tất cả lệnh bán đã được hấp thụ trong giai đoạn tích lũy. Nếu khối lượng bán vẫn còn nhiều ở trong thị trường với số lượng bất kỳ thì nến sẽ đóng cửa thấp hơn với khối lượng trên trung bình.

Khối lượng thấp vì thiếu lực bán nên Bigplayers di chuyển nến trở lại gần giá mở cửa với một 'tin tốt', trước khi tiếp tục đẩy giá cao hơn.
Những thử nghiệm với 'khối lượng thấp' này xảy ra trong tất cả các khung thời gian và ở tất cả các thị trường, và là một cách đơn giản Bigplayers đánh giá sự cân bằng của nguồn cung trong thị trường.
Rốt cuộc, họ đang cố gắng tạo ra nhu cầu ở đây, nhưng nếu có nguồn cung vượt mức trên thị trường thì điều này sẽ khiến chiến dịch tăng giá tạm dừng lại.
Trong trường hợp này, thử nghiệm đã thành công và xác nhận rằng mọi áp lực bán đã được loại bỏ. Sự hình thành chính xác của nến không quan trọng, nhưng thân nến phải nhỏ với một bấc dưới dài. Màu sắc của nến có thể là tăng hoặc giảm không quan trọng.
Với thử nghiệm đã xác nhận, Bigplayers có thể yên tâm đưa thị trường lên mức cao hơn, tự tin rằng tất cả các giao dịch bán cũ đã được hấp thụ
Kiểm tra khối lượng cao - Tin xấu !! - xem hình
Tuy nhiên, điều gì xảy ra nếu xuất hiện thanh khối lượng lớn và cây nến đóng cửa thấp, đánh dấu thị trường thấp hơn, đó là một vấn đề. Điều này đã dẫn đến việc thu hút người bán quay trở lại với số lượng lớn và thị trường sẽ di chuyển giá thấp hơn.
Rõ ràng trong thử nghiệm này, khối lượng bán ra đã không được thị trường hấp thụ hết trong giai đoạn tích lũy, do đó bất kỳ nỗ lực nào nữa để đẩy thị trường lên cao hơn có thể rất khó khăn hoặc thất bại.
Một bài kiểm tra thất bại chỉ ra rằng Bigplayers sẽ phải đưa thị trường giảm xuống một lần nữa một cách nhanh chóng để loại bỏ những người bán này ra.
Thị trường chưa sẵn sàng để tăng cao hơn và do đó Bigplayers có nhiều việc phải làm trước khi chiến dịch có thể được bắt đầu lại. Điều này tương đương với một
thử nghiệm thất bại trong một chiến dịch quảng cáo. Có lẽ giá cả của sản phẩm không hoàn toàn đúng hoặc thông điệp tiếp thị không rõ ràng. Dù bằng cách nào thì bài kiểm tra đã chỉ ra rằng một cái gì đó không đúng và cần được giải quyết. Đối với Bigplayers thì đó là sự hiện diện của quá nhiều người bán vẫn còn trên thị trường.
Chiến dịch 'lau dọn' ban đầu cần được khởi động lại, để kiểm tra lại nguồn cung khi thị trường bắt đầu tăng. Trong một thử nghiệm thất bại, chúng ta có thể chờ đợi thị trường trở lại khu vực thấp một lần nữa, để loại bỏ áp lực bán này trước khi chuẩn bị thoát ra với bài kiểm tra tiếp theo. Bất kỳ thử nghiệm tiếp theo nào với khối lượng thấp sẽ xác nhận rằng áp lực bán hiện đã được loại bỏ.
Kiểm tra là một trong những công cụ chính mà Bigplayers sử dụng trong tất cả các thị trường. Giống như mọi thứ khác trong PVA, đó là một khái niệm đơn giản, dựa trên logic đơn giản và một khi chúng ta hiểu khái niệm tích lũy và cấu trúc trên biểu đồ, chúng ta sẽ bắt đầu thấy các thử nghiệm xảy ra trong tất cả các khung thời gian với tất cả các chu kỳ.
Đây là một trong những tín hiệu mạnh mẽ nhất mà bạn sẽ thấy, vì Bigplayer đã gửi một thông điệp rõ ràng rằng thị trường sắp nổ ra và di chuyển cao hơn.
Trong ví dụ trên, Bigplayers đã kiểm tra áp lực bán (nguồn cung) còn lại trên thị trường sau giai đoạn tích lũy, để chuẩn bị cho chiến dịch đẩy giá lên cao.
Sau giai đoạn đẩy giá lên xa khỏi vùng tích lũy, thì thị trường tràn ngập người mua mới nhảy vào kiếm cơ hội gia tăng lợi nhuận, nhu cầu tăng vọt làm cho giá mua (Bid) liên tục nhảy lên cao trên biểu đồ. Với các lợi thế của mình Bigplayers nhìn thấy cơ hội xả hàng chốt lợi nhuận và họ bắt đầu bán, mở màn cho khu vực phân phối xuất hiện

Với giai đoạn phân phối thì ngược lại và bài kiểm tra mức cung lại được đưa ra. Cách thức thì ngươc lại cách kiểm tra mức cầu, chúng ta nên chú ý các mô hình nến, các nến đơn lẻ như: doji, hammer, shooting star... và volume





30/6
Xin chào mọi người.
Hôm nay chúng ta sẽ thực hành phân tích cặp AUDUSD.
Hiện tại xem xét trên khung H4 ta thấy cặp này đang hình thành sóng điều chỉnh B - chân sóng có dạng ABCD.
Phân tích trên AUD future chart H1 ta nhận thấy cặp tiền này đang di chuyển trong khung giá hẹp 0.684 - 0.689 - đang tích lũy để di chuyển lên trên, mục tiêu được dự đoán nằm trong khu vực 0.692 - 0.695 để hoàn thành sóng B.
Hiện tại xem xét trong khu vực tích lũy ta thấy khối lượng 2 lần tạo Buyingclimax tại khu vực đáy hộp chữ nhật. Hiện tại giá di chuyển cao hơn tiệm cận đỉnh trên của hộp, đồng thời đã bắt đầu test nguồn cung với 1 thanh khối lượng nhỏ - đây là tin tốt vì nguồn cung đã có dấu hiệu kiệt quệ.

Hiện tại chúng ta chờ cho giá phá vỡ hộp chữ nhật với khối lượng lớn đi kèm nhằm xác định phá vỡ cản trên.
Chênh lệch lợi suất trái phiếu 10 năm của AUD-US cho thấy xu hướng vẫn hỗ trợ đồng AUD
Đi kèm với PTKT thì thông tin cơ bản của RBA phát đi sáng nay cho thấy chính sách của RBA là có hỗ trợ cho AUD tuy không nhiều nhưng cũng đủ làm thị trườn an tâm.



1/7
Trong phần này tôi muốn chuyển sang cấp độ tiếp theo và giải thích các mô hình nến và nến khác nhau.
Tôi phải nhấn mạnh rằng phần này KHÔNG dành để phân tích mô hình nến Nhật.
Trong phần này tôi muốn giải thích những tổ hợp nến và mô hình nến đó là những thứ cần xem khi phân tích biểu đồ bằng VPA.

Chúng ta sẽ xem xét các nguyên tắc trước khi chuyển sang các ví dụ biểu đồ thực tế trong các phần tiếp theo..
1/ Nguyên tắc số một
Độ dài của bất kỳ bấc nến nào, tính đến đỉnh hoặc đáy của nến LUÔN LUÔN là điểm tập trung đầu tiên bởi vì nó bộc lộ cho thấy sức mạnh, điểm yếu và sự thiếu quyết đoán, và quan trọng hơn là mức độ của tâm lý thị trường.
2/ Nguyên tắc số hai
Nếu không có bấc được tạo ra, thì điều này báo hiệu tâm lý thị trường mạnh mẽ theo hướng giá đóng cửa.
3/ Nguyên tắc số ba
Một thân nến hẹp cho thấy một tâm lý thị trường yếu. Một thân nến lớn đại diện cho một tâm lý thị trường mạnh mẽ.
4/ Nguyên tắc số bốn
Một cây nến cùng loại sẽ có một ý nghĩa hoàn toàn khác nhau tùy thuộc vào nơi nó xuất hiện trong một xu hướng giá. Luôn luôn tham chiếu nến đến vị trí trong xu hướng lớn, hoặc trong giai đoạn hợp nhất.
5/ Nguyên tắc số năm
Khối lượng xác nhận giá. Bắt đầu với nến, sau đó tìm kiếm xác nhận hoặc bất thường của hành động giá qua khối lượng.
Chúng ta hãy bắt đầu những cây nến quan trọng nhất là nến bắn sao (the shooting star candle), nến búa (the hunmer candle) và Doji chân dài (the long legged doji candle)
I/ Nến bắn sao (shooting star)
Hành động giá - yếu kém.
Nến bắn sao là một trong ba mẫu nến quan trọng trong VPA mà chúng tôi xem trong tất cả các khung thời gian, và trong tất cả các sản phẩm và thị trường.
Hành động giá đang bộc lộ điểm yếu, vì giá đã tăng và sau đó giảm xuống gần mức giá mở cửa, với khối lượng người bán áp đảo người mua trong phiên.
Nến bắn sao xuất hiện trong mọi xu hướng, cả tăng và giảm, và tại mọi điểm trong xu hướng. Sự xuất hiện của chúng KHÔNG báo hiệu một sự đảo ngược ngay lập tức. Sự xuất hiện của chúng báo hiệu TIỀM NĂNG trong hành động giá. Nến chỉ đạt được ý nghĩa khi dựa trên khối lượng liên quan.
Đây là tín hiệu cổ điển của điểm yếu và chỉ có dựa trên khối lượng mới có thể đưa ra tín hiệu RÕ RÀNG về cường độ tương đối của điểm yếu này, và mức độ của bất kỳ sự đảo ngược nào.
Trong một xu hướng tăng, bất kỳ nến bắn sao nào có khối lượng dưới mức trung bình chỉ đơn giản là báo hiệu sự tạm dừng có thể xảy ra, có khả năng có 1 đảo ngược nhỏ. Theo tín hiệu như vậy, chúng ta cần xem xét khối lượng sau đó sẽ xem xét hành động giá trước đó và tiếp theo để xác nhận sự tiếp tục của xu hướng.
Xét trong xu hướng của thị trường hiện tại nếu có thêm nến bắn sao nữa với khối lượng trung bình, khi đó chúng ta có hai cây nến có tỷ lệ tương tự nhau trong một xu hướng và trong cùng một khung thời gian, chúng ta có thể so sánh khối lượng giữa hai cây nến. Nếu nến đầu tiên là dấu hiệu ban đầu của điểm yếu, thì nến thứ hai, với khối lượng tăng lên sẽ xác nhận điểm yếu này hơn nữa. Nếu khối lượng trên nến bắn sao thứ hai cao hơn nến thứ nhất, thì 'điểm yếu' đã tăng lên khi có nhiều đợt bán ra thị trường và buộc giá thấp hơn trong phiên.
Nếu chúng ta thấy một nến bắn sao, điều này có thể được coi là một dấu hiệu của sự yếu kém. Nếu chúng ta thấy hai nến bắn sao liên tiếp, hoặc tương đối gần nhau, điều này sẽ làm tăng tâm lý giảm giá. Nếu nến thứ ba xuất hiện thì càng làm tăng khả năng giảm giá.

Nói cách khác, nến đơn rất quan trọng, nếu nhiều lần xuất hiện của cùng một mẫu nến, trong cùng một khu vực giá, sẽ làm tăng theo cấp số nhân mức độ tâm lý giảm giá hoặc tăng giá. Và hãy nhớ rằng, đây chỉ mới dựa trên hành động giá. Nếu chúng ta thêm vào khối lượng lượng thì điều này đưa phân tích lên một cấp độ khác, đó là lý do tại sao tôi thấy thật kỳ lạ khi các nhà giao dịch PA không sử dụng khối lượng!

Hình minh họa trên biểu thị mối quan hệ giữa nến bắn sao và khối lượng, nó cho thấy thị trường sẽ giảm và lý do rất đơn giản. Đầu tiên, chúng ta đã thấy ba cây nến liên tiếp, có mức cao đã thất bại ở mức giá tương đương, nó cho thấy có sự từ chối giá lên trong khu vực này. Thứ hai, chúng ta có ba nến bắn sao, mà chúng ta đã biết đây là dấu hiệu của sự yếu đuối, và cuối cùng chúng ta có khối lượng. Chúng ta có khối lượng tăng trên ba cây nến giống hệt nhau ở cùng một mức giá tương đươn trên biểu đồ. Thị trường đang thực sự gặp khó khăn ở cấp độ này, và có thể được coi là một phần của cao trào bán.

Hơn nữa, nếu các tín hiệu này xuất hiện sau một thời gian hành động giá đi ngang, thì điều này sẽ cho các tín hiệu mạnh hơn nữa, khi đó chúng ta sẽ xem xét tới các mức kháng cự hoặc hỗ trợ. Rất dễ dàng khi phân tích lịch sử giá để nhìn lại và xác định đỉnh và đáy trong quá khứ. Nhưng sẽ rất khó khăn khi phân tích và xác nhận xu hướng giá trong thời gian thực, vì vậy tôi đã tạo sơ đồ dưới đây để giải thích hành động này diễn ra trên biểu đồ.

Hình minh họa trên, ta thấy phía bên trái của sơ đồ, thị trường đang có xu hướng tăng , khi một cây nến bắn sao xuất hiện trên biểu đồ, thậm chí có khối lượng trên trung bình. Liệu sự xuất hiện của cây nến này có nghĩa là một sự đảo ngược lớn của xu hướng hay chỉ đơn giản là một sự tạm dừng và điều chỉnh nhỏ? Nếu chỉ dựa trên một cây nến này thì không có gì chắc chắn và câu trả lời tốt nhất là không biết.

Sự xuất hiện của nến bắn sao đầu tiên là gợi ý của thị trường mà ta cần chú ý. Chúng ta nên đợi và kiểm tra các nến tiếp theo để xác nhận điểm yếu ban đầu và cố gắng suy luận với VPA xem đây có phải là dấu hiệu của sự yếu kém thực sự hay chỉ là tạm dừng. Tại thời điểm này, chúng tôi cũng sẽ xem xét các đầu mới là các khu vực tắc nghẽn giá trên biểu đồ. Xét cho cùng, nếu chúng ta đang ở trong một khu vực giá mà thị trường đã đảo chiều trước đó, thì đây cũng là một tín hiệu mạnh mẽ, và ngoài ra cũng có thể đưa ra một số manh mối về khả năng của bất kỳ sự đảo chiều nào.

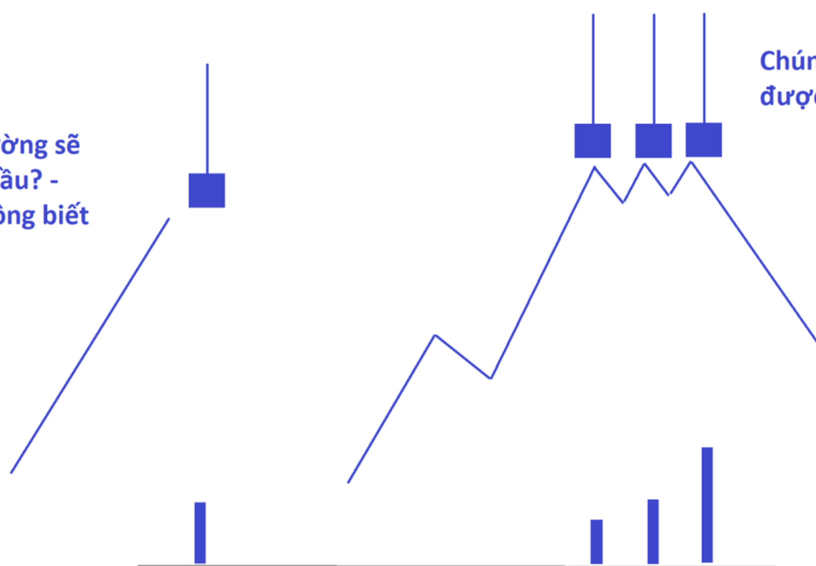
Ngoài ra, nếu hành động giá chỉ vừa mới thoát ra khỏi giai đoạn tích lũy, thì rất có thể đó không phải là khởi đầu của bất kỳ sự đảo chiều nào thấp hơn, và đây là điểm then chốt. Luôn luôn xem xét chúng ta đang ở đâu trong bối cảnh của xu hướng và mối quan hệ của nó với các khu vực hợp nhất gần đây của hành động giá nhất là khu vực tích lũy.

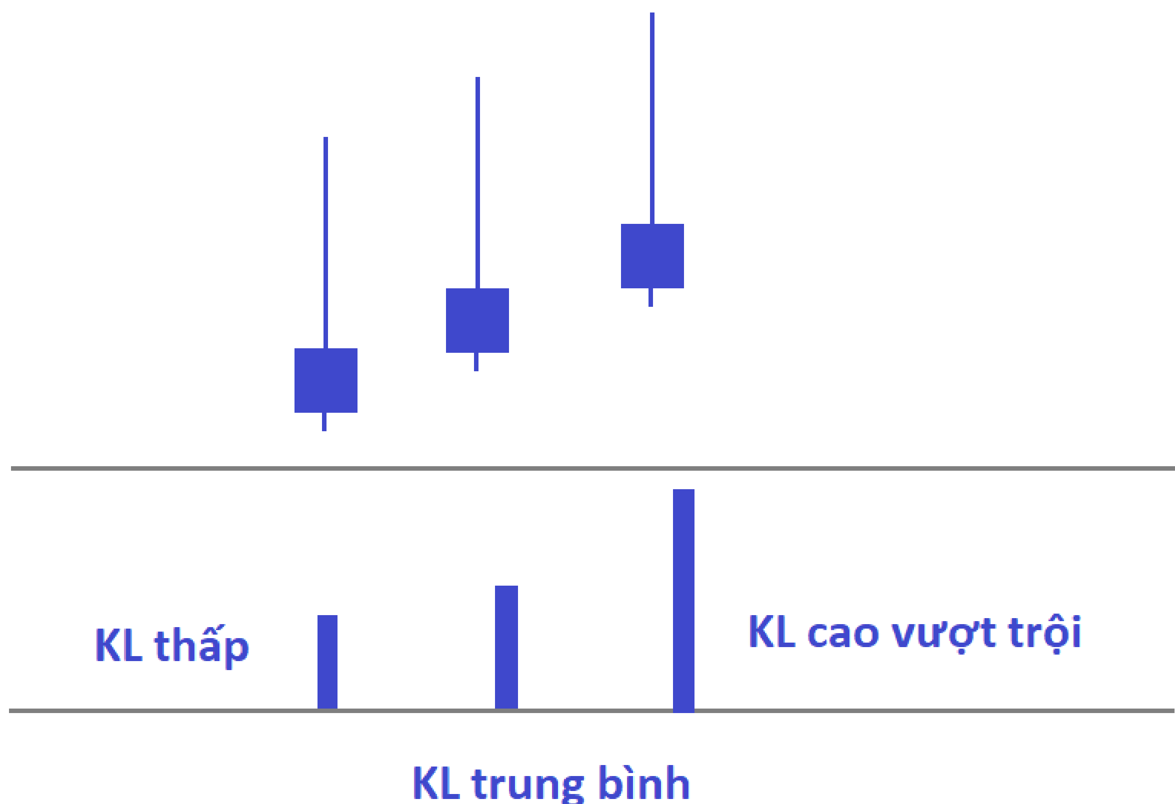
Rốt cuộc, rất khó có khả năng một xu hướng mới sẽ được bắt đầu sau khi giá vừa thoát khỏi khu vực hợp nhất. Vì vậy, bối cảnh của cây nến liên quan đến "bức tranh" lớn hơn là rất quan trọng. Bước tiếp theo là kiểm tra các khung thời gian cao hơn và thấp hơn để có góc nhìn rộng hơn về tín hiệu này và bối cảnh, cũng như áp dụng VPA cho các khung thời gian này.

Ví dụ: nếu hành động giá này xuất hiện trên biểu đồ một giờ và khi kiểm tra biểu đồ 15 phút, chúng ta có thể thấy hai nến bắn sao đã hình thành trong khung thời gian đó, cả hai đều có khối lượng trên trung bình, điều này cho thấy bất kỳ sự đảo ngược nào có thể có ý nghĩa hơn. Hơn nữa, biểu đồ 15 phút cũng có thể có các khu vực tắc nghẽn giá đáng kể cũng sẽ góp phần vào phân tích của chúng ta. Tất cả các phân tích này mất vài phút, nếu không phải vài giây trong khi chờ nến tiếp theo hình thành.

Sử dụng đa khung thời gian cũng cho chúng ta cái nhìn về xu hướng dài hạn hơn và cũng có thể giúp trả lời câu hỏi liệu sự xuất hiện của nến bắn sao này chỉ là một sự đảo ngược nhỏ hay bắt đầu thay đổi dài hạn. Đây là một trong nhiều lợi thế của việc sử dụng nhiều khung thời gian để

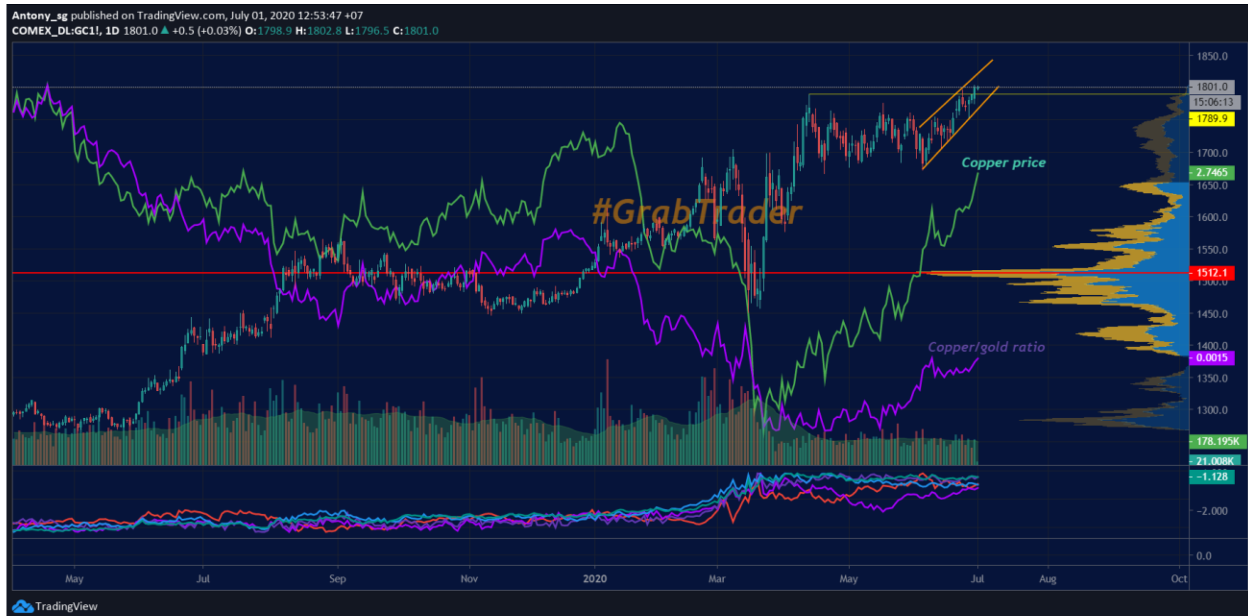
phân tích biểu đồ. Hơn nữa, sử dụng nhiều khung thời gian sẽ cho chúng ta cái nhìn tổng quát để giữ lệnh lâu hay nhanh.
Xét cho cùng, nếu xu hướng dài hạn là tăng và chúng ta đang có lệnh bán trên biểu đồ khung thời gian nhỏ hơn, thì có khả năng chúng ta sẽ chỉ giữ vị trí này trong một khoảng thời gian giới hạn, vì chúng ta đang giao dịch theo xu hướng ngắn hạn. Một lần nữa, điều này sẽ giúp trả lời câu hỏi liệu đây có phải là một sự đảo ngược xu hướng hay chỉ đơn giản là một khoảng điều chỉnh nhỏ.
Phân tích giá - khối lượng làmột nghệ thuật và không phải là một khoa học, đó là lý do tại sao phần mềm giao dịch rất khó khăn để có thể thực hiện phân tích này. Phân tích chúng tôi thực hiện trên từng cây nến, mẫu nến, khối lượng liên quan và giá liên quan trên nhiều khung thời gian để đánh giá và xác định xu hướng chi phối, tất cả đều mang tính chủ quan.
Năm nguyên tắc được đề cập ở đầu phần này áp dụng cho tất cả các loại nến và tất cả các phân tích VPA của chúng ta, nhưng vì nến bắn sao rất quan trọng , vì vậy tôi cảm thấy thích hợp để giới thiệu các khái niệm cơ bản của việc phân tích theo VPA ở đây.
Nến bắn sao chúng không chỉ xuất hiện theo xu hướng tăng mà còn xuất hiện theo xu hướng giảm, và ở đây chúng đóng vai trò xác nhận điểm yếu, đặc biệt nếu chúng xuất hiện ngay sau khi bắt đầu di chuyển xuống thấp hơn. Sự xuất hiện của một nến bắn sao trong một xu hướng giảm sau cao trào bán có thể là một thử nghiệm về lực cầu khi thị trường di chuyển thấp hơn. Hơn nữa, nếu nến bắn sao đi kèm với khối lượng thấp và thị trường đã bị tắc nghẽn trong một thời gian sau cao trào bán, điều này cũng xác nhận thị trường kiểm tra lực cầu bắt đầu rời khỏi giai đoạn phân phối. Nến bắn sao là một dấu hiệu cho thấy thị trường đã được đẩy lên cao hơn, nhưng không có nhu cầu nên rơi trở lại để đóng cửa, tại hoặc gần giá mở cửa.
Nến bắn sao cũng có thể xuất hiện ở các đảo ngược nhỏ trong xu hướng, khi áp lực giảm yếu lại và điều chỉnh. Một lần nữa, nếu nến đi kèm với khối lượng trên trung bình, nó chỉ cho chúng ta biết một điều đó là thị trường vẫn còn yếu và chúng ta chưa đạt đến đỉnh điểm mua ở dưới cùng của xu hướng.
Mô hình hành động giá này là những nhà tạo lập thị trường bắt đầu phân phối 1 phần nhỏ trong giỏ hàng mà họ đã thu thập được từ những người bán hoảng loạn trước đó. Họ sẽ bán dần khi thị trường di chuyển thấp hơn. Rốt cuộc, những nhà tạo lập thị trườngkhông muốn mua bất cứ nơi nào khác ngoài giá mục tiêu của họ, nói cách khác, tại giá bán buôn.
Một số người mua mới sẽ tham gia vào những đợt giảm giá này, nghĩ rằng thị trường đã chạm đáy và sắp tăng cao hơn, trong khi họ tiếp tục bán. Hành động giá này xảy ra mọi lúc trong các đợt giảm giá mạnh, khi thị trường di chuyển thấp hơn và nhanh hơn.
Tuy nhiên những nhà tạo lập thị trường cũng phải ngăn chặn sự sụp đổ, tìm cách đẩy thị trường cao hơn bằng cách sử dụng phương tiện truyền thông và bán vào nhu cầu được tạo ra trong khi cũng phải đối phó với việc bán tháo. Khối lượng do đó sẽ ở trên mức trung bình hoặc cao

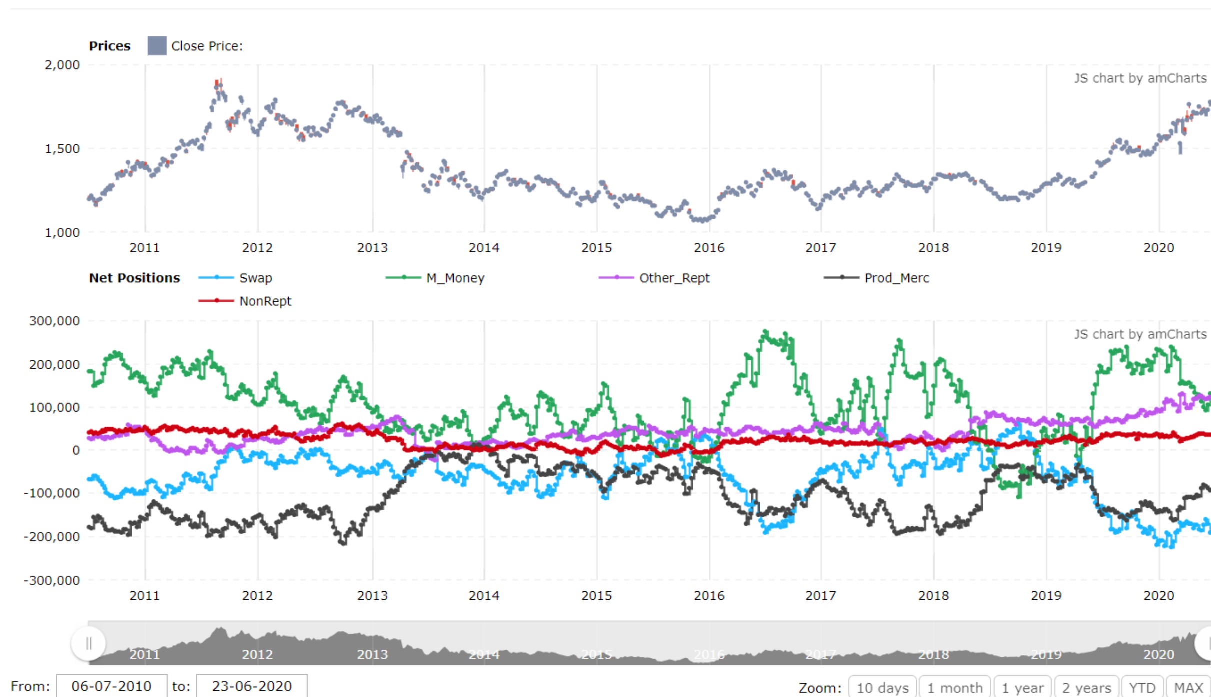

Thị trường sẽ
quay đầu? -
Tôi không biết
Chúng ta đã thấy hành động giá
được xác nhận bởi khối lượng



1/7/20
Trong các kim loại giao dịch trên thị trường thì giá đồng (màu xanh) có tính đối trọng tới giá vàng nhiều nhất do nó được sử dụng rất nhiều trong công nghiệp mà Trung Quốc là nước sử dụng nhiều nhất (kinh tế ổn định thì giá vàng đi xuống), với việc giá đồng liên tục tăng mạnh trọng thời gian gần đây nó là dấu hiệu chỉ báo sản xuất công nghiệp đang phục hồi, giá đồng đã tăng vượt mức trung bình của giai đoạn trước khi dịch Covid-19 bùng phát và đang tiệm cận mức cao của đầu năm 2020. Tỷ lệ giá đồng/ vàng (màu tím) đang tiếp tục tăng, theo logic thì nó sẽ áp lực lên giá vàng.
Những lo ngại gần đây về tỷ lệ lây nhiễm Covid-19 tăng lên là nguyên nhân dẫn tới giá vàng tăng cao gần chạm mức kỷ lục, nhưng xét khối lượng giao dịch thì vẫn thấp hơn trung bình của năm 2019 do giá đã ở mức cao so với nhu cầu thực sự. Xem xét trên báo cáo COT thì thấy vàng

chủ yếu được mua bởi các quỹ quản lý tiền nhưng tổng khối lượng vẫn thấp hơn trước đại dịch sau đợt bán tháo để bảo vệ danh mục đầu tư hồi tháng 3/ 2020
Xét trên PTKT trên chart Gold future thì vùng giá gần nhất mà được nhiều NĐT quan tâm nằm trong khu vực 1650 tiếp theo là 1500 – 1550. Và vàng đã chạm mức tâm lý ngắn hạn là 1800 nên khả năng tăng cao sẽ khó khăn.
Thông tin quan trọng nhất trong tuần này NFP có thể sẽ tích cực

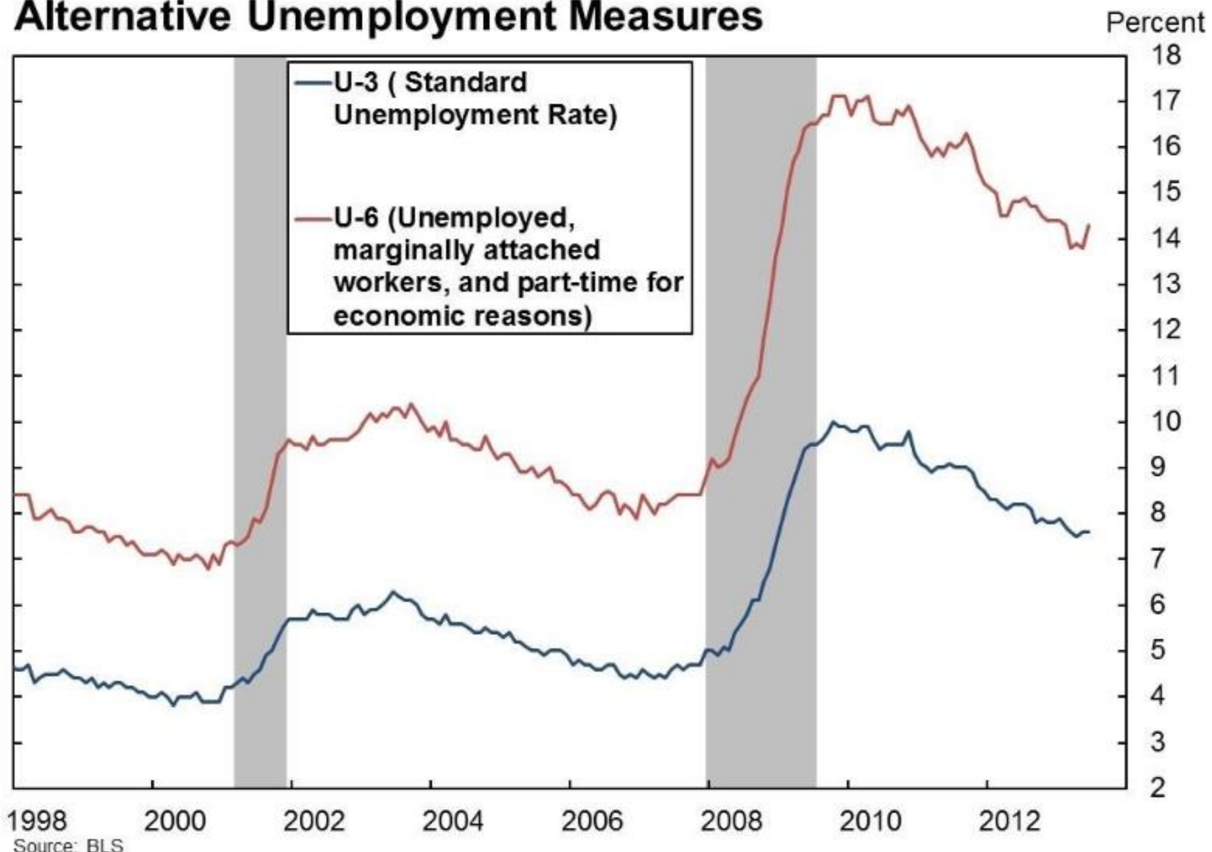


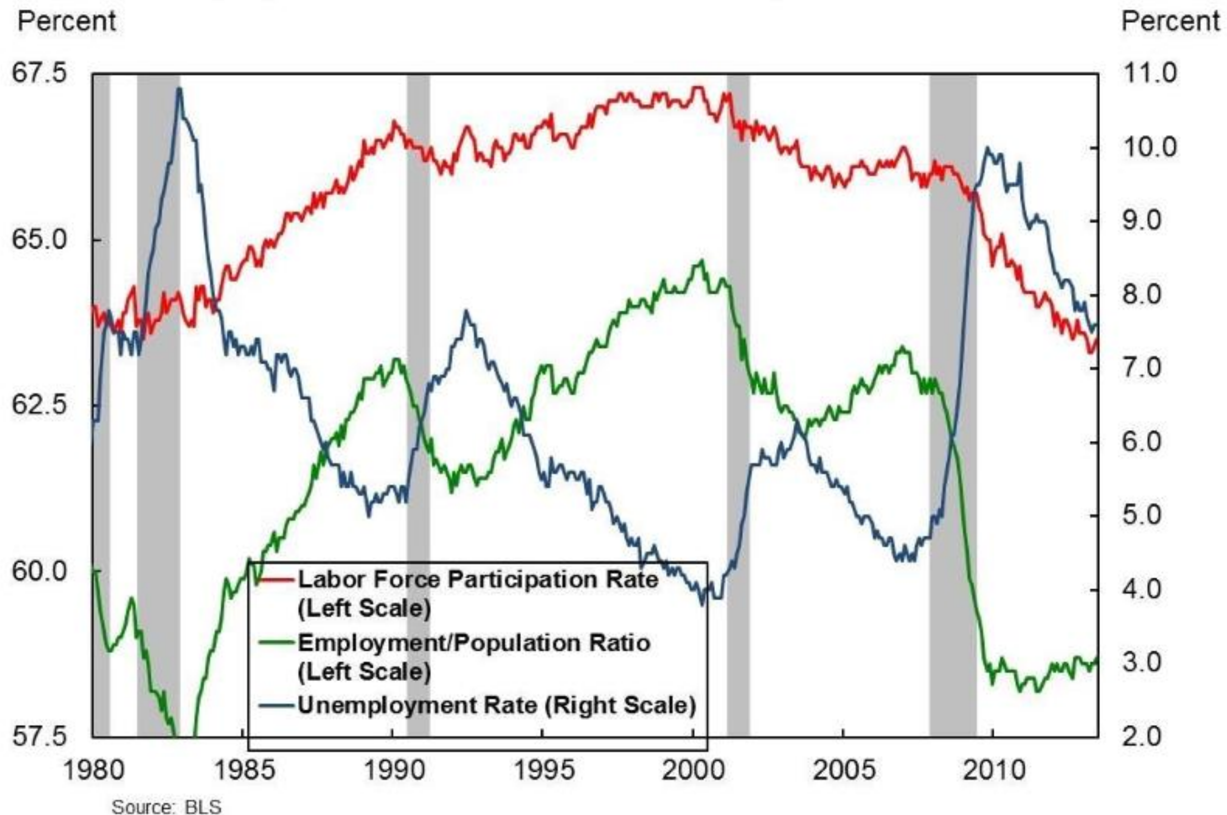


5/7/20

Cuối tuần rảnh rỗi lướt face thấy nhiều anh chị em Trader than thở sao kỳ NFP vừa rồi giá nó chạy như Shit?
Nếu các bạn có nền kiến thức về kinh tế tài chính ngân hàng thì có thể hiểu mỗi kỳ công bố NFP mỗi con số đều rất quan trọng, nó sẽ nói cho Trader biết động thái tiếp theo của Feb trong các kỳ họp FOMC, và có thể dự đoán động thái tiếp theo của Feb là nâng / hạ lãi suất, tiếp tục các chương trình QE hay kiểm soát đường cong lợi suất.
Feb là nhân tố quan trọng nhất trong thị trường tài chính và các biên bản họp FOMC là yếu tố quyết định hướng đi của thị trường trong tương lai vì tính tỷ trọng cao của USD so với rổ tiền tệ.
Vậy các thành viên FOMC xem xét các chỉ số thị trường lao động như thế nào khi đưa ra quyết định của họ?
Điều kiện thị trường lao động thực sự quan trọng trong các thảo luận chính sách tiền tệ của Ủy ban Thị trường mở (FOMC) thuộc Cục Dự trữ Liên bang. Các báo cáo của FOMC thường đề cập đến một ngưỡng giá trị của tỷ lệ thất nghiệp như là một phần thông tin mà Ủy ban sẽ theo dõi chặt chẽ. Điều này sẽ quyết định khi nào họ bắt đầu nâng / hạ lãi suất liên bang so với hiện tại, hoặc họ sẽ khởi động chương trình mua tài sản quy mô lớn, được biết đến với tên QE3, cho đến khi triển vọng thị trường lao động được cải thiện đáng kể trong bối cảnh phải ổn định giá cả (lạm phát).
Tại sao tỷ lệ thất nghiệp lại quan trọng đối với các quyết định chính sách tiền tệ?
Các mục tiêu mà Quốc hội Mỹ đưa ra cho Fed về chính sách tiền tệ là: tăng việc làm, ổn định giá cả (lạm phát) và lãi suất dài hạn vừa phải. Vì vậy thị trường lao động sẽ là một phần của các quyết định về chính sách tiền tệ. Những thành viên FOMC sẽ xem xét các chỉ số bao gồm sự tham gia của lực lượng lao động, chỉ số việc làm trong biên chế phi nông nghiệp và tỷ lệ thất nghiệp, tất cả đều được công bố bởi Cục Thống kê Lao động Hoa Kỳ (BLS).
Trong khi nhiệm vụ của chính sách tiền tệ là phải đảm bảo việc làm đầy đủ, tỷ lệ thất nghiệp thường là một chỉ số đáng tin cậy về điều kiện thị trường lao động. Tỷ lệ thất nghiệp chính thức thường biểu thị là U3, là tỷ lệ người thất nghiệp (16 tuổi trở lên, tích cực tìm kiếm việc làm) trên lực lượng lao động dân sự. Lực lượng lao động bao gồm những người lao động đang làm việc và những người tìm kiếm việc làm nhưng không bao gồm quân đội. Một chỉ số thay thế khác, chẳng hạn như tỷ lệ thất nghiệp U6, bổ sung những người thiếu việc làm vào U3. Cụ thể, U6 bao gồm những người làm việc bán thời gian không tự nguyện, nghĩa là họ thích làm việc toàn thời gian nhưng chưa tìm được. Nó cũng bao gồm những người vì nhiều lý do không tìm kiếm được việc làm nhưng muốn làm việc. Trong khi mức độ thất nghiệp của U3 và U6 khác nhau,
Hình 1. Mối tương quan giữ 2 chỉ số (xem hình Alternative Unemployment Measures)
Tỷ lệ thất nghiệp chính thức có xu hướng tương quan ngược chiều với tỷ lệ việc làm trên dân số, được đo bằng tỷ lệ người trưởng thành có việc làm (16 tuổi trở lên) so với dân số trưởng thành. Hình 2 biểu thị tỷ lệ thất nghiệp và tỷ lệ việc làm trên dân số trong 30 năm qua (thời kỳ suy thoái có màu xám). So sánh cho thấy, tỷ lệ thất nghiệp phản ánh tỷ lệ việc làm trên dân số trong phần lớn thời gian. Một số khác biệt giữa hai tỷ lệ phát sinh từ những thay đổi trong tỷ lệ tham gia của các lực lượng lao động. Tuy nhiên như Hình 2 cho thấy, hầu hết các biến động trong tỷ lệ dường như không theo chu kỳ thời gian, hay chu kỳ kinh doanh. Thay vào đó, nó có xu hướng liên quan đến các yếu tố khác như sự gia tăng của phụ nữ trong lực lượng lao động và thay đổi dân số cơ học (nhập cư). Con số cũng cho thấy tỷ lệ thất nghiệp có mối tương quan ngược chiều cao so với tỷ lệ việc làm trên dân số.

Hình 2. Sự sụt giảm gần đây về tỷ lệ thất nghiệp được thúc đẩy bởi sự sụt giảm tỷ lệ tham gia lực lượng lao động (thay vì cải thiện tỷ lệ việc làm trên dân số) - (xem hình Unemployment and Labor Force Participation Measures)
Ngoài ra họ còn quan tâm tới các chỉ số khác như tỷ lệ bỏ việc, sa thải, tuyển dụng, thu nhập bình quân theo giờ và hàng loạt danh sách khác.
Nói tóm lại là với mỗi kỳ NFP thì chúng ta cần xem xét tổng thể các chỉ số được phát hành và so sánh chúng với các kỳ trước ít nhất là trong chu kỳ 6 tháng.
VD trong kỳ này con số NFP khá tốt nhưng khi đưa vào bức tranh chung thì ta thấy nó không có nhiều ý nghĩa khi tỷ lệ thất nghiệp có cải thiện tuy nhiên vẫn còn rất cao so với đỉnh điểm của thời kỳ suy thoái năm 2010 là 10.2%, đồng thời thu nhập bình quân theo giờ giảm -1.2%. Điều này nói lên là chất lượng việc làm không tốt, có thể do tác động của Covid-19 nên trong tháng qua các việc làm có chất lượng cao không mở rộng tuyển dụng. Các con số cho thấy Feb sẽ tiếp tục theo dõi chứ khả năng chưa có bất kỳ hành động nào, do vậy thị trường thờ ơ không phản ứng.





23/10/20

MÔ HÌNH GIÁ VÀ KHỐI LƯỢNG (CƠ BẢN)

Khối lượng được sử dụng cho hai mục đích chính:

1. Để xác nhận những thay đổi về giá: nếu bắt đầu gia tăng của một xu hướng không đi kèm với gia tăng về khối lượng thì xu hướng được coi là yếu và thiếu hỗ trợ từ Smart Money.

2. Dự đoán những thay đổi về giá: sự gia tăng về khối lượng thường đi trước những thay đổi về giá. Xem Tích lũy và Phân phối để biết thêm chi tiết.

I. Xu hướng thị trường

1. Xu hướng ngắn hạn

* Xác nhận xu hướng:

- Giá tăng và khối lượng tăng báo hiệu một xu hướng tăng lành mạnh.
- Giá giảm và khối lượng tăng báo hiệu một xu hướng giảm lành mạnh.

(Xem hình bên)

* Xu hướng suy yếu:

- Giá tăng và khối lượng giảm báo hiệu xu hướng suy yếu.
- Giá giảm và khối lượng giảm có thể báo hiệu xu hướng suy yếu. Xem Khối lượng thấp trong Xu hướng giảm để biết thêm chi tiết.

(Xem hình bên)

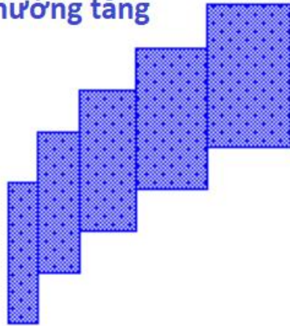
Giá giao động trong phạm vi hẹp trong thời gian dài với khối lượng thấp cho thấy sự thiếu quan tâm của người bán (nếu giá tăng) hoặc người mua (nếu giá giảm).

II. Xu hướng dài hạn

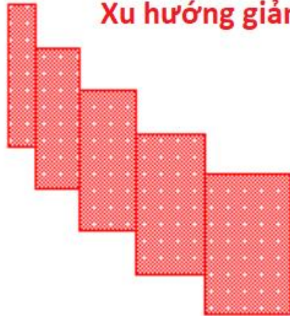
1. Xác nhận xu hướng:
- Các đỉnh cao hơn với khối lượng lớn hơn ở các đỉnh báo hiệu một xu hướng tăng tốt.
- Các đáy thấp hơn với khối lượng cao hơn tại các đáy báo hiệu một xu hướng giảm dài hạn.
2. Xu hướng suy yếu:
- Các đỉnh cao hơn với khối lượng thấp hơn ở các đỉnh báo hiệu rằng xu hướng tăng đang suy yếu.
- Các đáy thấp hơn với khối lượng tại các đáy thấp hơn báo hiệu rằng xu hướng giảm đang suy yếu.
3. Tích lũy và phân phối
- Tích lũy và phân phối cho biết ai đang kiểm soát thị trường và thường báo hiệu sự đảo chiều.
- Biên độ giao dịch đại diện cho sự tích lũy hoặc phân phối dài hạn.
3.1 Tích lũy
- Tích lũy là khi thị trường được kiểm soát bởi người mua.
- Xu hướng giảm bị suy yếu trong khi khối lượng vẫn ở mức cao cho thấy sự tích lũy đang diễn ra. Người bán đã mất quyền kiểm soát vào tay người mua và khả năng xảy ra đảo chiều.
* Tích lũy xảy ra khi:
- Khối lượng tăng (so với ngày hôm qua) và giá đóng cửa tăng cao hơn, hoặc
- Sau quá trình giá đi xuống, có rất ít hoặc không có sự chuyển động của giá nhưng có sự gia tăng về khối lượng.
3.2 Phân phối
- Phân phối là khi thị trường được kiểm soát bởi người bán.
- Xu hướng tăng yếu đi trong khi khối lượng vẫn ở mức cao là một dấu hiệu cho thấy sự phân phối đang diễn ra. Người mua đã mất quyền kiểm soát đối với người bán và khả năng xảy ra đảo chiều.
* Phân phối xảy ra khi:
- Khối lượng tăng (so với ngày hôm qua) và giá đóng cửa giảm, hoặc
- Sau quá trình giá có xu hướng đi lên, thì có rất ít hoặc không có biến động giá và khối lượng tăng lên.
II. Phá vỡ phạm vi giao dịch
- Khi giá giao dịch trong một phạm vi, khối lượng có thể cho biết hướng nào có khả năng xảy ra đột phá nhất:
- Khối lượng cao hơn trước khi tạo đỉnh có nghĩa là có nhiều khả năng xảy ra đột phá hơn
- Khối lượng cao hơn trước khi tạo đáy cho thấy có nhiều khả năng phá vỡ
1. Sử dụng khối lượng để xác nhận đột phá:
- Khối lượng cao ngay sau khi đột phá cho thấy một sự đột phá có sức mạnh.
- Khối lượng thấp ngay sau khi bứt phá cho thấy sự suy yếu.
2. Cao trào trong xu hướng
Sau khi một xu hướng đã đạt được mức tăng/ giảm đáng kể, thường có sự gia tăng hoặc giảm về giá và khối lượng, điều này có thể báo hiệu rằng xu hướng sắp kết thúc. Chú ý:
- Đỉnh chóp, đáy chóp (spikes)
- Giá giao động hẹp trong thời gian dài
- Xuất hiện mô hình khoảng trống kiệt sức (Exhaustion Gap)
- Mô hình đảo chiều
III. Khối lượng thấp trong xu hướng giảm
Khối lượng thấp không nhất thiết báo hiệu sự kết thúc của một xu hướng giảm. Cam kết từ người mua là cần thiết để đẩy giá lên. Giá có thể giảm do cả người mua và người bán không quan tâm.

Khối lượng xác nhận xu hướng

Xu hướng tăng



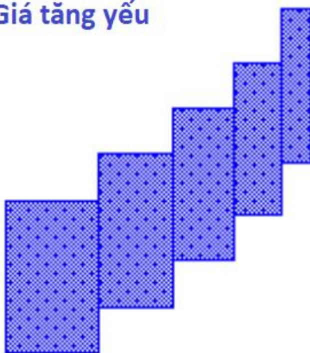
Xu hướng giảm



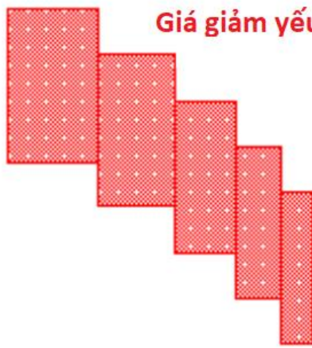
Độ rộng: khối lượng giao dịch

Xu hướng suy yếu

Giá tăng yếu



Giá giảm yếu



Độ rộng: khối lượng giao dịch

24/10/20

FEB - NHÂN TỐ QUAN TRỌNG NHẤT TRÊN THỊ TRƯỜNG TÀI CHÍNH TOÀN CẦU
1) Fed là gì?
Cục Dự trữ Liên bang, còn được gọi là Fed (The Federal Reserve System), là hệ thống ngân hàng trung ương của Hoa Kỳ. Fed thành lập vào năm 1913, khi Quốc hội ban hành Đạo luật Dự trữ Liên bang. Nhiệm vụ của Fed Fed là cung cấp dịch vụ tài chính cho các tổ chức lưu ký và chính phủ Hoa Kỳ, giám sát và điều chỉnh một số loại tổ chức tài chính, thiết lập chính sách tiền tệ và duy trì sự ổn định của hệ thống tài chính.
2) Cấu trúc của Feb
Cục Dự trữ Liên bang có cấu trúc gồm hai phần: một cơ quan trung ương được gọi là Hội đồng Thống đốc đặt tại Washington, DC và một mạng lưới phi tập trung gồm 12 Ngân hàng Dự trữ Liên bang nằm trên khắp Hoa Kỳ. Một trong những chức năng rõ ràng nhất của Fed diễn ra tại

các cuộc họp của Ủy ban Thị trường mở Liên bang (FOMC), nơi tập hợp các thành viên của Hội đồng Thống đốc và chủ tịch của Ngân hàng Dự trữ để thiết lập các chính sách tiền tệ.
Cấu trúc của Fed đã được Quốc hội Mỹ thiết lập để đảm bảo rằng chính sách tiền tệ được cách ly khỏi áp lực chính trị. Các quyết định của Fed cũng được bảo vệ khỏi sự can thiệp từ các nhánh khác của chính phủ liên bang. Cụ thể, các quyết định chính sách và hoạt động không yêu cầu sự chấp thuận của Quốc hội hoặc Tổng thống. Ngoài ra, hoạt động của Fed không được tài trợ bởi ngân sách từ Quốc hội. Fed có thể tự tài trợ ngân sách của mình thông qua lãi thu được từ trái phiếu của chính phủ Hoa Kỳ mà họ nắm giữ, lãi cho các công ty tài chính vay và phí được tính cho các ngân hàng. Trong khi cấu trúc của Fed bảo vệ nó khỏi áp lực chính trị, Quốc hội vẫn có quyền thay đổi các luật điều chỉnh Fed và cấu trúc của nó. Ngoài ra, Fed thường xuyên báo cáo Quốc hội về chính sách tiền tệ và các vấn đề khác, và phải trải qua một quá trình kiểm toán hàng năm. Do đó, Fed thường được mô tả là độc lập trong với chính phủ, trực tiếp hoặc là một cơ quan bán chính quyền.

HỘI ĐỒNG THỐNG ĐỐC

Hội đồng thống đốc hoạt động như một cơ quan chính phủ độc lập.

Trung tâm cấu trúc Cục Dự trữ Liên bang là Hội đồng Thống đốc tại Washington, DC, Hội đồng có trách nhiệm giám sát toàn bộ Hệ thống Dự trữ Liên bang và hoạt động như một cơ quan chính phủ độc lập. Hội đồng gồm có 7 thành viên được Tổng thống đề cử và được Thượng viện xác nhận. Các thành viên phục vụ các nhiệm kỳ 14 năm và so le hết hạn trong các năm chẵn. Nhiệm kỳ 14 năm là một đặc trưng trong cấu trúc của Fed được thiết kế để bảo vệ các thành viên Hội đồng khỏi áp lực chính trị. Từ các thành viên này, Tổng thống cũng chỉ định một Chủ tịch và hai Phó Chủ tịch Hội đồng thống đốc để với nhiệm kỳ bốn năm. Những vai trò lãnh đạo này phải được Thượng viện phê chuẩn và có thể được gia hạn.

NGÂN HÀNG DỰ TRỮ LIÊN BANG

Mười hai Ngân hàng Dự trữ Liên bang thực hiện phần lớn các hoạt động hàng ngày của hệ thống, 12 Ngân hàng Dự trữ Liên bang khu vực thực hiện nhiều hoạt động hàng ngày của Hệ thống. Các Ngân hàng Dự trữ, còn được gọi là ngân hàng khu vực, được tổ chức như một loại hình tổ chức phi lợi nhuận đặc biệt, hoạt động vì lợi ích công cộng. 12 ngân hàng khu vực có trụ sở tại Boston, New York, Philadelphia, Cleveland, Richmond, Atlanta, Chicago, St. Louis, Minneapolis, Kansas City, Dallas và San Francisco. Chi nhánh của Ngân hàng Dự trữ được đặt tại 24 thành phố khác.
Mỗi Ngân hàng Dự trữ và mỗi chi nhánh của họ có một ban giám đốc. Các hội đồng địa phương bao gồm các cá nhân từ các lĩnh vực khác nhau của cộng đồng của họ. Một số cá nhân đại diện cho các ngân hàng thương mại là thành viên của Hệ thống Dự trữ Liên bang. Các ban giám đốc khác đại diện cho các doanh nghiệp địa phương và người lao động, người tiêu dùng và các khu vực phi lợi nhuận trong cộng đồng của họ. Mỗi Ngân hàng Dự trữ có một chủ tịch được bổ nhiệm bởi hội đồng quản trị, trừ các giám đốc đại diện cho các ngân hàng thương mại. Hội đồng thống đốc phải phê chuẩn các kết quả này.

ỦY BAN THỊ TRƯỜNG MỞ LIÊN BANG (FOMC)

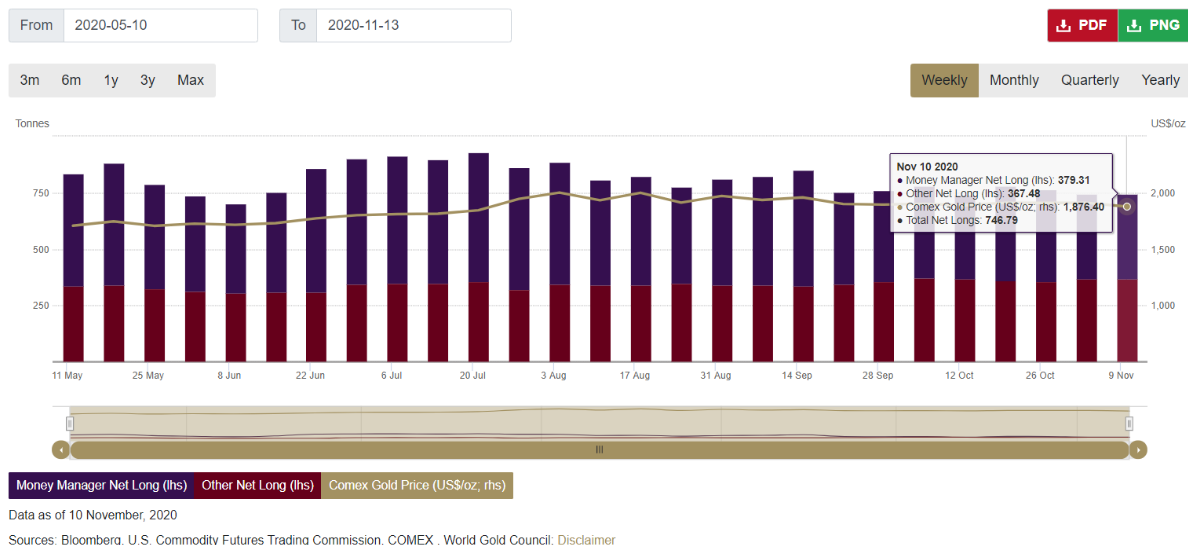
FOMC là cơ quan hoạch định chính sách tiền tệ của Feb

Ủy ban thị trường mở liên bang (FOMC) là cơ quan hoạch định chính sách tiền tệ của Fed. FOMC có 12 thành viên bỏ phiếu, bao gồm cả bảy thành viên của Hội đồng Thống đốc và một nhóm luân phiên gồm năm chủ tịch Ngân hàng Dự trữ. Chủ tịch Hội đồng Thống đốc cũng là Chủ tịch của FOMC. Chủ tịch Ngân hàng Dự trữ Liên bang New York giữ chức Phó Chủ tịch FOMC. Fed trực tiếp tham gia vào việc thực hiện các hoạt động chính sách tiền tệ, vì vậy chủ tịch của nó có quyền biểu quyết thường trực đối với FOMC. 11 chủ tịch Ngân hàng Dự trữ khác

phục vụ các nhiệm kỳ một năm với tư cách là thành viên bỏ phiếu trên cơ sở luân phiên. Tất cả 12 chủ tịch Ngân hàng Dự trữ đều tham gia các cuộc họp của FOMC, cho dù họ có phải là thành viên bỏ phiếu hiện tại hay không.
FOMC tổ chức tám cuộc họp định kỳ thường xuyên một năm tại Washington, DC. Trong mỗi phiên họp, các nhà kinh tế tại Hội đồng Thống đốc và Ngân hàng Dự trữ phân tích các điều kiện kinh tế và tài chính khu vực, quốc gia và quốc tế. Vào ngày cuối cùng của mỗi cuộc họp FOMC, các hành động chính sách tiền tệ được đưa ra để bỏ phiếu. Sau cuộc họp, FOMC đưa ra một tuyên bố bằng văn bản. Mỗi tuyên bố mô tả cách ủy ban xem các điều kiện kinh tế, hành động chính sách và hướng dẫn về tiến trình chính sách trong tương lai. Ba tuần sau mỗi cuộc họp FOMC, biên bản chi tiết được công bố. Biên bản bao gồm các mô tả về quan điểm của Ủy ban về điều kiện kinh tế và lý do cho các quyết định chính sách. Sau thời gian tổ chức năm năm, bảng điểm thực tế của mỗi cuộc họp FOMC cũng được phát hành.
Tại sao tỷ lệ thất nghiệp lại quan trọng đối với các quyết định chính sách tiền tệ?
Điều kiện thị trường lao động thực sự quan trọng trong các thảo luận về chính sách tiền tệ của Ủy ban thị trường mở (FOMC) của Cục dự trữ liên bang, mục tiêu mà Quốc hội đưa ra cho Fed về chính sách tiền tệ là việc làm tối đa, giá cả ổn định và lãi suất dài hạn vừa phải.
Những thành viên FOMC sẽ xem xét các chỉ số, bao gồm sự tham gia của lực lượng lao động, việc làm trong biên chế phi nông nghiệp (ngoại trừ chính phủ và quân đội) và tỷ lệ thất nghiệp Các báo cáo của FOMC đề cập đến một ngưỡng giá trị của tỷ lệ thất nghiệp như là một phần thông tin mà Ủy ban sẽ theo dõi chặt chẽ. Điều này sẽ quyết định khi nào họ bắt đầu nâng / hạ lãi suất cơ bản so với hiện tại, hoặc họ sẽ khởi động chương trình mua tài sản quy mô lớn,được biết đến với tên QE3, cho đến khi triển vọng thị trường lao động được cải thiện đáng kể trong bối cảnh phải ổn định giá cả (lạm phát).
TRUYỀN THÔNG FOMC
FOMC đã thực hiện một số bước để cởi mở hơn về chính sách tiền tệ. Chủ tịch Cục Dự trữ Liên bang tổ chức các cuộc họp báo thường xuyên sau mỗi cuộc họp của FOMC. Ngoài ra, Ủy ban thường xuyên cập nhật và phát hành một tài liệu có tên là Tuyên bố về các mục tiêu dài hạn và chiến lược chính sách tiền tệ. Tài liệu này phác thảo cách các nhà hoạch định chính sách của Fed diễn giải nhiệm vụ kép của Fed từ Quốc hội để thúc đẩy việc làm và giá cả ổn định. Các thành viên FOMC cũng đưa ra quan điểm của họ về hướng khả thi của chính sách tiền tệ trong tương lai trong một tài liệu có tên là Tóm tắt các dự báo kinh tế. Ủy ban công bố những dự báo này bốn lần mỗi năm.
NHỮNG THAY ĐỔI GẦN ĐÂY
Ngoài ra còn có hai thực thể bổ sung trong Fed được thành lập năm 2010 do Đạo luật Dodd-Frank:
- Cục bảo vệ tài chính người tiêu dùng là một cơ quan tự trị hoạt động trong Fed nhằm bảo vệ người tiêu dùng trong các vấn đề tài chính.
- Văn phòng thiểu số và hòa nhập phụ nữ đẩy mạnh sự tham gia của Fed với các doanh nghiệp thuộc sở hữu của phụ nữ và người thiểu số, xem xét các chính sách đa dạng bao gồm cả các tổ chức tài chính mà Fed giám sát.

14/11/20
Chủ đề Volume chúng ta đã tiếp cận gần như là những kiến thức cơ bản nhất, và để có cái nhìn bao quát về công cụ này, hôm nay tôi sẽ chia sẻ thêm về cái nhìn có chiều sâu để ACE hiểu thêm.

Volume - khối lượng là 1 khái niệm ra đời rất lâu, nhưng cũng là công cụ bí ẩn nhất đối với các nhà giao dịch nhỏ lẻ (retail traders), bởi khi đọc và hiểu nó thì bạn đã trở thành 1 nhà giao dịch có lợi nhuận và đứng cùng phía các nhà tạo lập thị trường (right side), còn không thì ngược lại. Thị trường chứng khoán có thể cung cấp khối lượng tương đối chính xác nhưng với thị trường FOREX thì gần như không thể chính xác do tính chất phi tập trung của thị trường.
Để các bạn có khái niệm về khối lượng mình sẽ lấy thị trường Vàng để các bạn hình dung rõ nét. Giá vàng mà các bạn nhìn thấy hàng ngày là mức giá đã được thống nhất bởi các ngân hàng lớn (các bạn có thể google). Khối lượng giao dịch để hình thành nên giá thì từ các thị trường sau: OTC + Exchanges + Gold ETFs, trong đó OTC có khối lượng giao dịch lớn nhất được báo cáo bởi LBMA (chủ yếu giao dịch vàng vật chất) có tính chất quyết định tới giá vàng hàng ngày (báo cáo khối lượng giao dich hàng ngày tinh theo USD - tỷ USD). Exchanges là tập hợp các sàn giao dich tương lai và quyền chọn, điển hình là COMEX, Shanghai, Tokyo, LME ... Gold ETFs là các quỹ giao dịch vàng (hợp đồng + vật chất) nhỏ hơn rất nhiều so với 2 thị trường trên. Gold ETF mà retail traders hay tham khảo nhất là SPDR Gold Share.
Các báo cáo hàng tuần (COT) thường là báo cáo từ COMEX cho chúng ta cái nhìn về động thái giao dịch của các thể chế lớn (các ngân hàng lớn, quỹ quản lý tài sản lớn ....) trên sàn COMEX để đa dạng danh mục đầu tư và thường ở dạng danh mục đầu cơ ngắn hạn phòng ngừa rủi ro. Gold ETFs thì nằm trong danh mục nhà đầu tư nhỏ do khối lượng thấp, nhưng đây là nhóm đầu tư khá nhạy cảm với thị trường và theo báo cáo của WGC thì tính tới 30/10/2020 thì nhóm ETF Bắc Mỹ đã ở trạng thái bán ròng.
Vậy để có khả năng phân tích khối lượng thì chúng ta cần thu thập khá nhiều thông tin để có cái nhìn cùng chiều với các nhà tạo lập thị trường trước khi sử dụng công cụ trên biểu đồ để phân tích. Phân tích khối lượng là nghệ thuật chứ không giống như 1 phép tính đơn giản, chúng ta vẫn có thể sử dụng Tick Volume để phân tích và đọc trạng thái thị trường.
Các bạn có thể tham khảo các hình đính kèm.



Trading Volumes



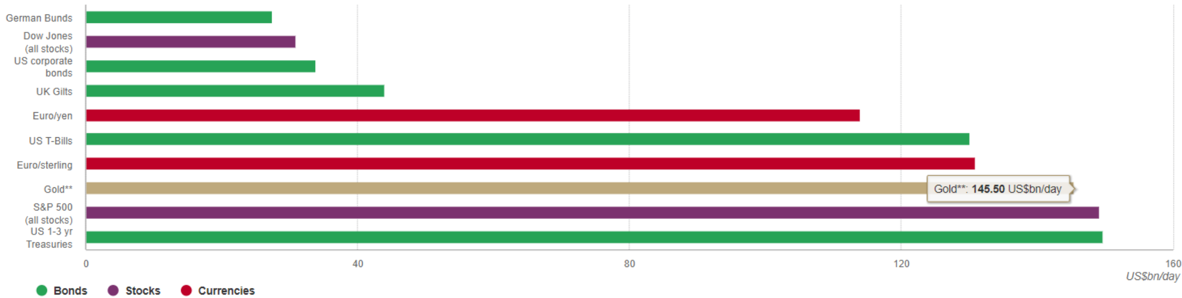
		FY 2019	YTD 2020	Q3 2020	QTD	Sep 2020	Oct 2020	MTD
▶ OTC	Pre-LBMA-i (Mid †)							
	LBMA-i ††	44.89	*63.72	70.33	*59.48	67.08	58.08	*65.67
	Non-LBMA-i (Mid ‡)	33.67	*47.79	52.75	*44.61	50.31	43.56	*49.25
	Total (Mid)	**78.56**	***111.52**	**123.08**	***104.09**	**117.39**	**101.64**	***114.92**
Exchanges	COMEX	48.47	56.31	64.18	45.58	57.52	40.21	58.71
	Shanghai Futures Exchange	8.82	6.22	8.79	6.67	8.59	6.22	7.47
	Shanghai Gold Exchange §	5.97	6.36	6.98	2.94	5.21	3.38	*4.40
	LME ∂	0.35	0.16	*0.14	*	*0.01	*0.01	*0.01
	All other exchanges ^	1.77	2.41	2.56	2.25	2.16	1.88	3.27
	Total Exchanges	**65.37**	**71.46**	***82.64**	***57.44**	***73.49**	***51.70**	***73.86**
Gold ETFs	North America	1.43	2.70	3.27	2.14	2.46	1.89	2.74
	Europe	0.07	0.14	0.14	0.12	0.13	0.11	0.14
	Asia	0.26	0.52	0.66	0.54	0.57	0.53	0.56
	Other	0.01	0.03	0.03	0.02	0.02	0.02	0.02
	Total gold-backed ETFs	**1.78**	**3.39**	**4.10**	**2.81**	**3.19**	**2.55**	**3.46**
Total	**Global gold market liquidity**	**145.71**	***186.37**	***209.83**	***164.35**	***194.07**	***155.90**	***192.24**

Data as of 13 November, 2020

Sources: Bloomberg, COMEX , Dubai Gold & Commodities Exchange, ICE Benchmark Administration, London Metal Exchange, Multi Commodity Exchange of India, Nasdaq, Shanghai Gold Exchange, Shanghai Futures Exchange, Tokyo Commodities Exchange, World Gold Council; Disclaimer

Average annual trading volumes

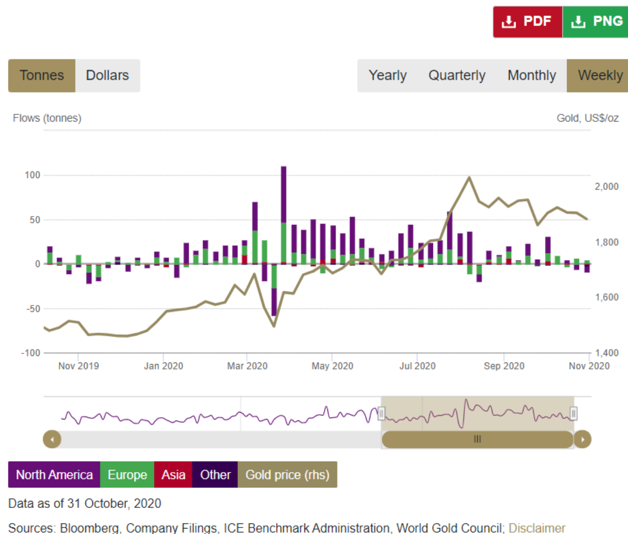
Average daily trading volumes in US dollars*



Data as of 31 December, 2019

Sources: Bloomberg, Bank for International Settlements, UK Debt Management Office (DMO), Germany Finance Agency, Japan Securities Dealers Association, Nasdaq, World Gold Council; Disclaimer

*Based on estimated one-year average trading volumes as of 31 December 2019, except for currencies that correspond to March 2019 volumes due to data availability.



Data as of 31 October, 2020

Sources: Bloomberg, Company Filings, ICE Benchmark Administration, World Gold Council; Disclaimer

Country ETF flows

Country	AUM (US$bn)	Holdings (tonnes)	Change tonnes	Flows (US$mn)	Flows (% AUM)
US	121.7	2,011.8	635.6	36,079.1 ▲	53.5%
UK	47.5	784.9	202.5	11,349.7 ▲	39.8%
Germany	23.7	392.4	24.8	1,269.0 ▲	7.1%
Switzerland	22.5	372.0	35.9	1,631.7 ▲	9.9%
Canada	4.8	79.6	15.2	800.1 ▲	25.4%
China P.R. Mainland	4.1	67.8	23.1	1,298.6 ▲	59.2%
France	3.7	61.1	39.2	2,107.1 ▲	197.1%
Australia	2.2	36.9	14.3	826.8 ▲	74.7%
India	1.7	27.6	11.1	624.7 ▲	77.5%
South Africa	1.4	23.9	2.4	110.8 ▲	10.5%
Japan	1.3	20.9	6.3	368.0 ▲	51.4%
Italy	0.4	6.7	3.0	170.9 ▲	94.1%
Ireland	0.4	6.4	6.4	347.2 ▲	NaN%
Hong Kong SAR	0.2	3.6	0.6	37.2 ▲	25.0%
Turkey	0.1	1.3	0.7	40.4 ▲	139.0%
Liechtenstein	0.0	0.8	0.1	0.0 ▲	0.0%
Saudi Arabia	0.0	0.5	0.5	29.1 ▲	NaN%
Malaysia	0.0	0.4	0.2	13.5 ▲	120.6%
Thailand	-	-	-0.1	-6.0 ▼	-111.7%

Year to date 31 October, 2020

Top and bottom ETF flows

Top 10 flows	Country	Holdings (tonnes)	Change tonnes	Flows (US$mn)	Flows (% AUM)
SPDR Gold Shares	US	1,257.3	364.3	20,513.8 ▲	46.9%
iShares Gold Trust	US	527.1	167.1	9,630.1 ▲	54.6%
iShares Physical Gold ETC	UK	252.0	108.4	5,939.0 ▲	84.5%
Invesco Physical Gold ETC	UK	233.5	87.6	4,927.7 ▲	69.0%
SPDR Gold MiniShares Trust	US	61.2	38.1	2,164.1 ▲	191.0%
Amundi Physical Gold ETC	France	61.1	39.2	2,107.1 ▲	197.1%
Sprott Physical Gold Trust	US	78.8	28.5	1,619.8 ▲	65.8%
Aberdeen Standard Physical Gold Shares	US	44.2	19.7	1,117.6 ▲	93.5%
Xetra-Gold	Germany	223.0	19.5	1,094.6 ▲	11.0%
WisdomTree Physical Gold GBP Daily Hedged	UK	22.1	12.0	745.9 ▲	150.5%

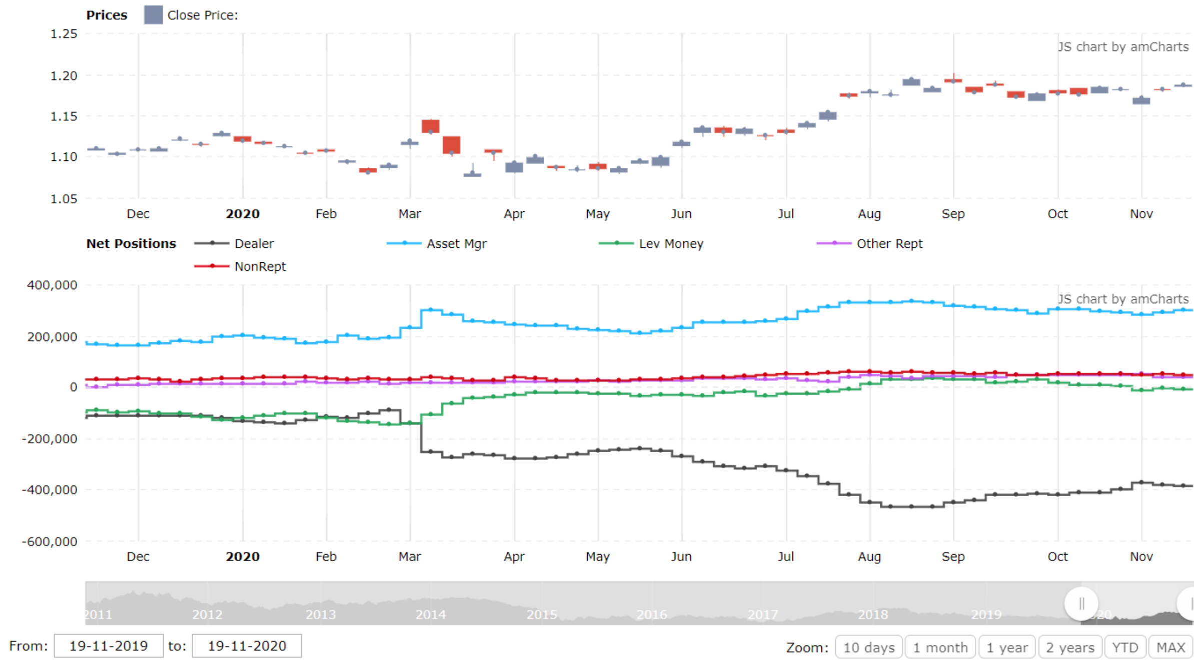
20/11/20
Chào toàn thể anh chị em.
Nhân cuối tuần rảnh rỗi tôi viết tiếp về thị trường tài chính toàn cầu, đây là thị trường lớn nhất và thanh khoản nhất, điều này anh chị em có thể goole để biết tôi không đi sâu vào vấn đề này. Cái tôi đi sâu vào phân tích là tại sao phần lớn trader nhỏ lẻ (92 - 95%) (retail traders) lại thất bại và từ bỏ sau khoảng thời gian 1 vài tháng tới 1 vài năm theo đuổi thị thường trong vô vọng.
Một sự thật là thị trường được thiết kế giành cho các tay chơi lớn (Big boiz) vốn chỉchiếm số lượng khoảng 5%, nhưng khối lượng họ giao dịch tới 92 - 95% thị trường và họ có sân chơi riêng. Thứ 2 là phần đông retail traders là tự phát, tay ngang nhảy vào thị trường do đó tỷ lệ thất bại gần như tới 95 - 96%. Số còn lại 4 -5 % retai traders thành công là hoặc họ xuất thân từ bank trader, hoặc họ kiên trì học hỏi và tự tìm ra phương pháp giao dịch không giống như trên sách vở.
Có một sự thật nữa là tất cả các phương pháp trong các sách dạy trading đã lỗi thời, không còn giá trị hoặc chỉ còn giá trị tham khảo trong dạy học.
Bởi vì thị trường tài chính quá to lớn và nó ảnh hưởng tới xương sống của hệ thống ngân hàng toàn cầu nên các thông tin rất ít được chia sẻ do tính chất OTC của nó, các ngân hàng lớn, các quỹ quản lý tài sản và các quỹ tương hỗ có mối quan hệ có tính chất liên thông nội bộ nên rất khó cho các retail traders tìm kiếm thông tin thực có lợi cho mình.
Vậy làm thế nào để thành công trong giao dịch tài chính tiền tệ
1/ Cần phải có kiến thức cơ bản nhất về thị trường (hiện nay có rất nhiều sách viết về đề tài này) - đọc có chọn lọc. Nếu anh chị nào Tiếng Anh tốt có thể tự học qua web: investopedia.com
...
2/ Chi tập trung vào 1 vài cặp tiền tệ, hàng hóa, chứng khoán mà mình quan tâm nhất và học các phân tích các thông tin ảnh hưởng tới thị trường dài hạn cũng như ngắn hạn. Khuyến nghị

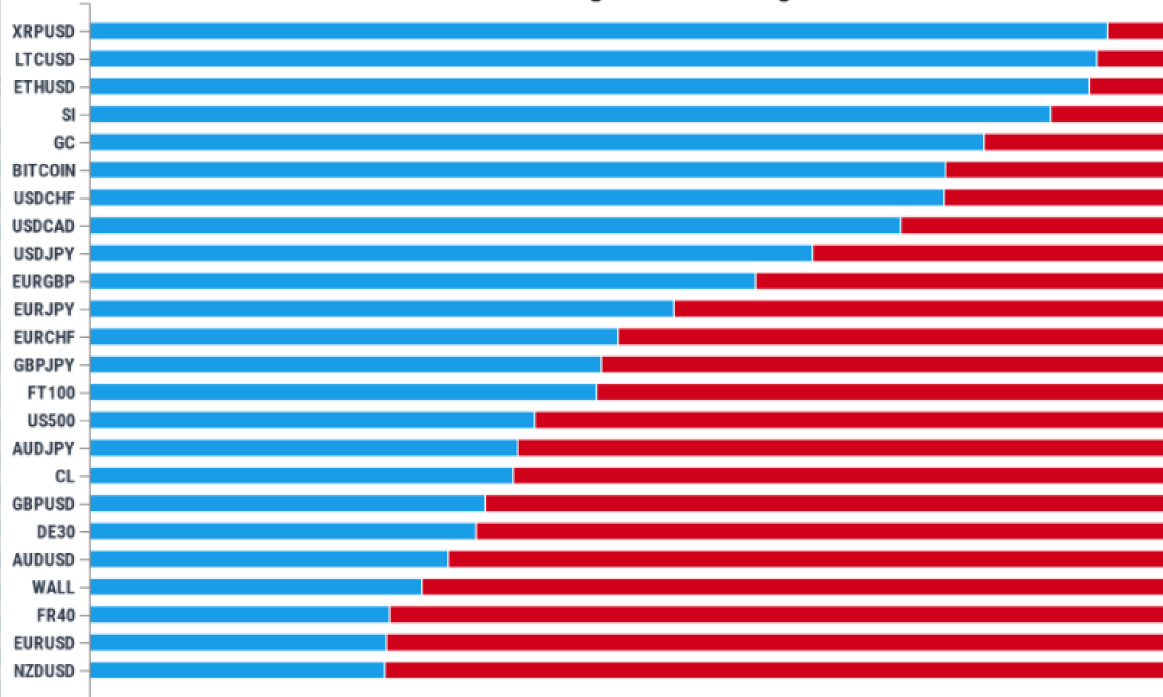
các bạn nên tập trung nghiên cứu các cặp EURUSD do khối lượng giao dịch lớn và thông tin dễ tìm kiếm, khá minh bạch
3/ Bắt buộc phải lập bảng theo dõi các chỉ số, thông tin cơ bản ảnh hưởng tới sản phẩm đó, theo dõi các tài khoản Twiter chuyên về tài chính.
4/ Học cách phân tích các yếu tố liên thị trường ảnh hưởng tới sản phẩm đó.
5/ Thu thập và phân tích các thị trường tương lai và quyền chọn để xem xét các khu vực, vùng giá có tiềm năng trở thành các mức cản kỹ thuật. Các website tham khảo: cmegroup.com, gold.org, barchart.com ...
6/ Hạn chế sử dụng phân tích kỹ thuật để dự đoán hướng đi của thị trường, chỉ nên sử dụng phân tích kỹ thuật sau khi đã thực hiện đủ các bước trên để xác định hướng đi của thị trường hiện tại, tìm khu vực giao dịch tiềm năng có độ rủi ro thấp nhất.
7/ Bắt buộc phải thực hiện quản lý vốn sau khi đã xác định khu vực vào lệnh với độ rủi ro thấp nhất R:R
8/ Luôn lắng nghe thị trường, bỏ cái tôi ra ngoài khi giao dịch, không cố chống lại thị trường khi phân tích bị sai
9/ Các website có thể tham khảo : fxstreet.com, think.ing.com, gbm.scotiabank.com ...
Cách thức tiếp cận và thu thập thông tin tôi đã post trong 2 bài gần nhất, anh chị em tìm đọc lại

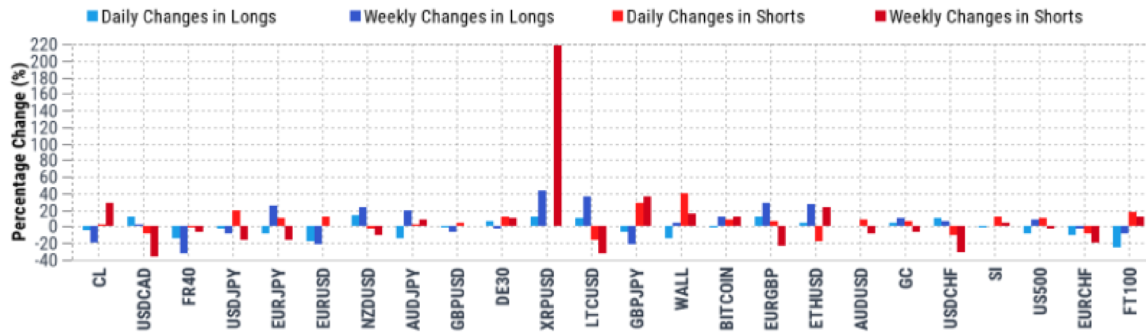
25/11
Trong qúa trình phân tích kỹ thuật chúng ta thường đặt câu hỏi: mức hỗ trợ và kháng cự hiện tại là khu vực giá nào?
Chúng ta nên sử dụng mức kháng cự và hỗ trợ để xác định khu vực giá nhập lệnh giao dịch với rủi ro (R:R) thấp nhất. Vậy làm sao để có thể xác định các khu vực này? (tôi không sử dụng đường line để xác định điểm kháng cự và hỗ trợ mà sử dụng vùng giá).
Thường thì anh chị em hay xác định khu vực này trên đồ thị lịch sử giá, nhưng chúng ta nên biết thị trường luôn vận động và biến thiên không ngừng, giá vận động do các tổ chức lớn thực hiện giao dịch với khối lượng lớn. Do đó nếu sử dụng chart thì nên sử dụng chart có khung thời gian lớn (tôi thiểu từ H4 trở lên)
Tôi thường theo dõi các hợp đồng Option (CME) để xác định các khu vực giá tiềm năng bằng cách theo dõi các hợp đồng hội tụ nhiều ở vùng giá nào (xem trên hình)
Các trader lớn thường có sự đồng thuận nhất định về khu vực giá có thể trở thành kháng cự và hỗ trợ tiềm nẵng, bằng cách theo dõi các hợp đồng Otption ta có thể thấy rõ ràng hơn khi kết hợp vẽ vùng giá tiềm năng trên đồ thị.
Các hợp đồng Option thường được sử dụng để hedge các vị thế đã mở của họ, và các mức giá thường sử dụng số chẵn được đưa ra bởi các Writer (người viết / bán các hợp đồng).
Ngoài ra ta còn theo dõi trên bảng Option để xác định các vùng giá chuyển các vị thế giao dịch. Ví dụ trên bảng Option đính kèm ta có thể nhìn thấy vùng giá 1.19 hiện tại đang thể hiện là mức kháng cự với giá nằm dưới và 1.18 là vùng giá hỗ trợ cho vùng giá nằm trên bằng cách so sánh các tỷ lệ Call/Put trong bảng trên.

Ngoài ra để xác định Bias thị trường tôi theo dõi sát sao các báo cáo COT (CFTC) để biết các vị thế của nhóm Asset Manage đang nghiêng về mua hay bán, đây cũng là 1 chỉ số xác định tâm lý thị trường nói chung.
Và cũng để theo dõi tâm lý của nhóm retail traders tôi cũng quan sát sentiment report trên Dailyfx và tỷ lệ thay đổi long/ short trong tuần/ngày.
Các chỉ số trên là về kỹ thuật, để có thể dự đoán hướng đi sắp tới trong dài hạn thị còn theo dõi các thông tin cơ bản và các phát biểu của các quan chức có tính ảnh hưởng cao đối với cặp tiền/ hàng hóa đó.
Do thị trường có tính vận động rất cao, và việc PTKT chỉ mang tính chất Bias, do đó tôi khuyên anh chị em nên theo dõi thông tin để xem xét các phản ứng của thị trường nhằm tránh thua lỗ lớn nhất.
Hiện tại xem xét trên cặp tiền EURUSD thì về mặt kỹ thuật cho thấy vùng giá quanh 1.19 đang là mức cản khá cứng khi giá đã liên tục test và giảm xuống khi tiếp cận. Tuy nhiên tại thời điểm viết bài này tôi nhận thấy khả năng thị trường có thể chấp nhận giao dịch với giá cao hơn, có xu hướng hướng tới vùng giá 1.195 và 1.2
Nguyên nhân cho sự gia tăng là các thông tin tốt về đàm phán giữa EU và London về quá trình Brexit của Anh Quốc.
Hiện tại tôi đang chờ London mở của để xác định xem mức giá 1.19 có thực sự bị phá vỡ và trở thành Support cho chu kỳ tăng giá tới hay không.
Phân tích khối lượng trên giao dịch hợp đồng tương lai (future contract), tương ứng với spot thì thấy ngày 23/11 sau khi giá giảm về 1.18 đã được các Bigboiz mua với khối lượng lớn và ngày hôm qua 24/11 khối lượng mua tiếp tục gia tăng khi giá điều chỉnh về vùng giá 1.185
Từ các phân tích trên tôi nhận thấy khả năng rất cao cặp tiền này sẽ vận động tăng hướng tới khu vực 1.195 và 1.2

Prices & Net Positions




IG Client Sentiment
DAILYFX
provided by IG
Current Percentage of Clients Long/Short
XRPUSD
LTCUSD
ETHUSD
SI
GC
BITCOIN
USDCHF
USDCAD
USDJPY
EURGBP
EURJPY
EURCHF
GBPJPY
FT100
US500
AUDJPY
CL
GBPUSD
DE30
AUDUSD
WALL
FR40
EURUSD
NZDUSD


Changes in Long and Short Positions
Daily Changes in Longs
Weekly Changes in Longs
Daily Changes in Shorts
Weekly Changes in Shorts
Percentage Change (%)
220
200
180
160
140
120
100
80
60
40
20
0
-20
-40
CL
USDCAD
FR40
USDJPY
EURJPY
EURUSD
NZDUSD
AUDJPY
GBPUSD
DE30
XRPUSD
LTCUSD
GBPJPY
WALL
BITCOIN
EURGBP
ETHUSD
AUDUSD
GC
USDCHF
SI
US500
EURCHF
FT100

EUR/USD (EUU) OPEN INTEREST

AS OF 11/23/2020

	6EZ0 20 DTE 1.1909		6EH1 111 DTE 1.1935						6EM1 202 DTE 1.1927				
STRIKES	EUUZ0 9 DTE		EUUF1 44 DTE		EUUG1 72 DTE		EUUH1 100 DTE		EUUJ1 135 DTE		EUUK1 163 DTE		STRIKES
	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	
1.1625		485											1.1625
1.1650	346	1,791	245	307	50	364	3	148		56		224	1.1650
1.1675		468											1.1675
1.1700	333	1,802	200	1,711	38	379	322	900	49	85	1	211	1.1700
1.1725	1	469											1.1725
1.1750	831	2,314	630	1,731	285	292	864	743	203	4			1.1750
1.1775	29	544											1.1775
1.1800	2,693	2,418	231	1,926	295	95	883	835		30	139	2	1.1800
1.1825	53	271											1.1825
1.1850	2,025	1,081	414	682	1,245	233	345	336		14		268	1.1850
1.1875	509	69											1.1875
1.1900	4,220	130	1,718	937	497	120	1,061	32	10		70		1.1900
1.1925	500	4											1.1925
1.1950	1,403	25	1,681	151	139	155	478	55	50				1.1950
1.1975	465												1.1975
1.2000	4,742	80	1,186	14	240	13	714	3			137	30	1.2000
1.2025	460												1.2025
1.2050	1,435	59	1,349		219		103	3	40				1.2050
1.2075	436												1.2075
1.2100	1,364	35	514	1	576		2,235	2	180		100		1.2100
1.2150	1,155	18	655	1	148	3	704		1,140				1.2150
1.2200	711	14	289	5	582		803		31		50		1.2200
1.2250	559		509		195		936		93				1.2250
1.2300	1,379	3	358		534		330		91		21		1.2300

	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	CALL	PUT	
STRIKES	EUUZ0 9 DTE		EUUF1 44 DTE		EUUG1 72 DTE		EUUH1 100 DTE		EUUJ1 135 DTE		EUUK1 163 DTE		STRIKES
	6EZ0 20 DTE 1.1909		6EH1 111 DTE 1.1935						6EM1 202 DTE 1.1927				

SETTLEMENT ATM   CURRENT ATM

28/12/20
Trong các bài viết tôi thường đề cập tới các mức giá có sự hội tụ lớn của các hợp đồng option, đồng thời diễn biến giá khi tiệm cận các mức này khi gần tới ngày hết hạn thường có mức giằng co rất lớn giữa 2 mức giá hội tụ nhiều hợp đồng nhất.
Trên chart GC (gold future) hôm nay chúng ta thấy giá có biên độ co giật rất mạnh giữa 2 mức giá 1900 và 1880. Điều này cho thấy trong hợp đồng OGF1 - hết hạn lúc 10h New York hôm nay có trạng thái Call khá lớn, điều này cho thấy phía Writer (người viết hợp đồng) có ý định kéo giá thấp xuống dưới 1880 để tránh phải thanh toán với mức thiệt hại lớn. Phía Buyer (người mua hợp đồng) cố ý kéo qua 1900 để hưởng chênh lệch, nhưng không đủ nguồn lực.
TDo hôm nay vẫn là ngày nghỉ lễ nên phía Writer có đủ nguồn lực để đè giá xuống, trong khi phía Buyer lại yếu thế hơn.
Nhìn xa hơn về tuần trước thì sau khi giá chạm 1900 đã có 1 khối lượng xả hàng rất lớn nhằm ngăn chặn giá lên và quét giá khá sâu tới 1855 nhằm shake-out các lệnh mua yếu thế, nhằm tạo thuận lợi cho phe bán.
Khi kết hợp khối lượng và các mức hợp đồng Option lên đồ thị + khối lượng, nó sẽ dễ dàng hơn cho cái nhìn tổng thể và diễn biến thị trường khá logic.
Theo quan điểm các nhân tôi thị trong phiên hôm nay trước 10h NewYork giá sẽ tiệm cận sát 1880, có thể quét tới 1875 trước khi bật tăng trở lại 1900





29/12/20

Khi phân tích khối lượng trong giao dịch đối với các sản phẩm bất kỳ, các nhà giao dịch nhỏ lẻ luôn tự hỏi các Bigboyz họ dặt lệnh ở đâu? Họ đang mua hay bán? Vùng giá nào đang được các tay chơi lớn quan tâm? Thiên hướng của họ là đang ủng hộ thị trường giá lên hay giá xuống? Vùng nào có tiềm năng mua bán tốt nhất? ....

Nếu chỉ phân tích nến thông thường và sử dụng các indicator thì rất khó xác định được, nguyên nhân các trader nhỏ lẻ thường xuyên thua lỗ nằm ở vấn đề nhận thức, và các kiến thức khi nạp vào bộ não có xu hướng sẽ dẫn dắt tâm lý và thường tạo ra ý chí chủ quan, nhìn thị trường theo cảm tính cá nhân và khó khăn trong việc nhận thức các điều kiện khách quan

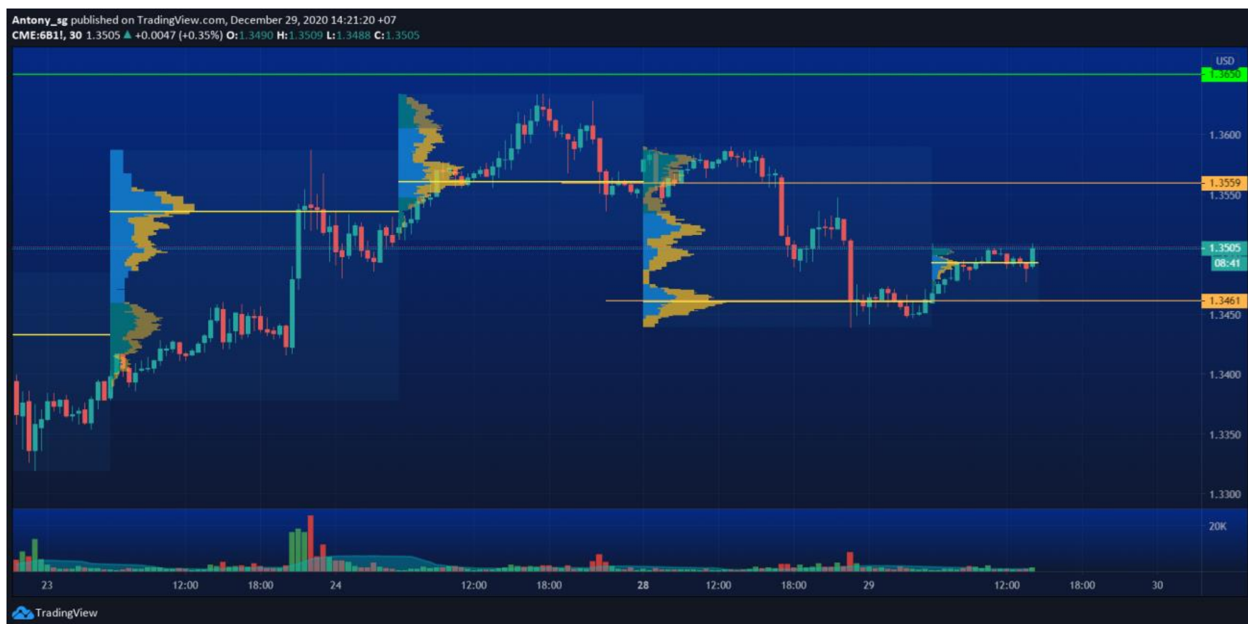
Thức tế giá di chuyển không phải do kỹ thuật hay indicator, cũng không phải là mô hình nến. Giá có xu hướng di chuyển lên tục dựa trên các thông tin tức thời trên thị trường, các Bigboyz theo dõi rất chặt chẽ các luồng thông tin chủ đạo dẫn dắt thị trường, nhưng họ không phải lúc nào cũng giao dịch hay theo dõi màn hình 24/24, họ có ý chí định hướng theo các luồng thông tin chính dẫn dắt thị trường tại từng thời điểm và họ có thể thay đổi rất nhanh theo các luồng thông tin đó

Các Bigboyz họ thường giao dịch với các lô lớn và gần như không sử dụng đòn bẩy, ví dụ với FX lô tối thiểu là 1,000,000 đơn vị tiền tệ bằng tiền thật, với vàng là lô 100 ounce, các hợp đồng tương lai thường theo quy định của các sàn giao dịch. Các vị thế Long - Short của các bank traders nắm giữ thường rất lớn và tỷ lệ khối lượng họ giao dịch thay mặt khách hàng rất lớn, chỉ khi nào họ có thông tin chắc chắn họ mới thực hiện lệnh giao dịch của chính họ (tổ chức của họ).

Các hoạt động tạo nên thị trường tài chính rất phức tạp và được thiết kế để phục vụ các khách hàng lớn (tập đoàn, công ty lớn, các tổ chức bảo hiểm, quỹ hưu trí, các ngân hàng thương mại, các quỹ đòn bẩy ...). Khối lượng giao dịch hàng ngày theo "Ngân hàng thanh toán quốc tế" khảo sát năm 2019 khoảng 6,6 nghing tỷ/ ngày: trong đó 2k tỷ cho spot, 1k tỷ cho các sản phẩm kỳ hạn, 3,2k tỷ cho các hoạt động hoán đổi ngoại hối, 108 tỷ cho hoán đổi tiền tệ và khoảng 295 tỷ cho quyền chọn và các sản phẩm khác

Sơ lược qua như vậy để chúng ta thấy rằng khối lượng giao dịch thực sự rất quan trọng và có thể nói là quan trọng nhất trong giao dịch ngoại hối và đặc quyền này gần như chỉ giành cho

khoảng 10 ngân hàng lớn trên toàn cầu. Mặt khác do tính chất OTC của thị trường nên thông tin về khối lượng gần như không công khai ra ngoài, và họ có kênh riêng để trao đổi với nhau.
Tuy nhiên chúng ta vẫn có thể mua data từ các nguồn uy tín để phân tích khối lượng giao dịch như các Broker lớn, hoặc các nhà cung cấp nền tảng uy tín cho retail trader như Ninja, Tradingview ...
CME là sàn giao dịch tập trung cho các hợp đồng tương lai và quyền chọn lớn nhất thế giới, giống như nền tảng của Reuters và Bloomberg. Những dữ liệu này được cung câp cho khách hàng của họ với phí đăng ký khá cao.
Ở Việt Nam thì phân mềm trả phí rẻ, tốt phù hợp với số đông trader là Tradingview và tôi cũng sử dụng phần mềm này để phân tích trước khi giao dịch trên tài khoản thực.
Phân tích khối lượng có 3 phương pháp phổ biến: phân tích VPA (Volume - Price - Analysis), Phân tích Volume profile và Phân tích Order Flow hay Footprint
- VPA thì thường phân tích quá trình tích lũy - phân phối để phát hiện đảo chiều giá để giao dịch theo Bigboyz, phân tích các mô hình giá - khối lượng bất thường để xác định xu hướng và diễn tiến khối lượng tại từng thời điểm phân tích
- Volume Profile thì thường phân tích diễn biến khối lượng giao dịch tại từng khoảng giá hoặc điểm gia nhằm phát hiện khu vực giá được quan tâm nhiều nhất, ít nhất (High volume note - Low volume note - POC), nhằm phát hiện ra hoạt động thực sự của các Bigboyz tại khi vực đó
- Order Flow - footprint: phân tích giải phẫu khối lượng thị trường tại từng điểm giá nhằm phát hiện ra các khối lượng lệnh lớn tham gia vào thị trường, khu vực mất cân bằng khối lượng (imbalance) Bid-Ask, khu vực retail trader bị trap hay khi vực Bigboyz nhập lệnh
Với các công cụ hoặc indicator khác 1 trader có thể học để tự code được, nhưng với khối lượng thì bắt buộc phải trả phí, và gói phí data không có miễn phí và các phần mềm phân tích khối lượng cũng khá đắt đỏ với số đông retail traders.
Nếu tình hình tài chính không cho phép các bạn có thể đăng ký gói Pro+ trên Tradingview và tập phân tích Volume - Volume profile. Sau 1 thời gian thành thạo các bạn có thể tự tin giao dịch trên tk tiền thật.
(Các bạn có thể bỏ thêm công cụ VWAP vào biểu đồ để xác định giá đi có động lực của khối lượng hay không)
Với đồng Bảng Anh, do các thông tin về Brexit đã bão hòa nên hiện giờ thông tin đáng theo dõi tiếp là gói cứu trợ mới 2000$/ người của Mỹ đang được trình lên Thượng Viện Mỹ. Trên đồ thị GBP future tôi đánh dấu 2 vùng giá quan trọng cho ngày hôm nay (màu cam), khi giá phát triển tới khu vực tiệm cận 2 vùng giá đó tôi sẽ theo dõi chặt chẽ diễn biến khôi lượng để xác định hướng đi tiếp theo của đồng Bảng Anh.
Happy Trading!



30/12/20

Volume Profile (Phần 1)

Với tất cả những người tham gia vào giao dịch mua bán một sản phẩm bất kỳ đều quan tâm tới 1 mức giá thỏa thuận hợp lý, nói một cách dân dã là "thuận mua vừa bán". Người mua muốn mua 1 món hàng với giá thấp, người bán muốn bán với giá cao hơn, hai bên sẽ tiến hành thương lượng trả giá và sẽ chốt deal với mức giá mà cả 2 bên cảm thấy hài lòng nhất. Đây là 1 tiến trình rất tự nhiên để hình thành mặt bằng giá.

Trong phân tích khối lượng, Volume profile (VP) sẽ cho thấy điều đó, nơi tập trung khối lượng lớn HVN (High volume note) là nơi tập trung các lần thương lượng giá nhiều nhất và cũng là nơi sẽ quyết định giá vượt lên hay đi xuống. Nơi giá có khối lượng giao dịch lớn nhất gọi là POC (Point of control), tại sao HVN và POC là khu vực quan trọng nhất?

Trước khi tạo xu hướng giá mới cho thị trường, các Bigboyz cần tích lũy hoặc phân phối giỏ hàng của mình, họ luôn muốn mua, bán nhiều mà lại không tạo độ xáo trộn nhiều về giá và vùng HVN thường đại diện cho các khu vực đó, đặc tính vùng giá này là nơi có hoạt động khối lượng lớn nhât trong 1 khoảng thời gian nhất định (H, D, W, M), ngụ ý rằng đây là mức giá được cả 2 phe mua bán quan tâm nhiều nhất

Trên VP ta còn thấy vùng LVN (Low volume note) là vùng giá có khối lượng giao dịch thấp nhất và giá có xu hướng di chuyển qua rất nhanh, ngụ ý rằng thị trường dường như không quan tâm tới khu vực giá này

POC là điểm giá quan trọng nhất khi phân tích VP. Trong chu kỳ tăng hay giảm giá, POC thường phát triển theo xu hướng thị trường, nó cho thấy quan điểm của Bigboyz đang như thế nào.

Xem xét trên VP các khu vực HVN thường đại diện cho vùng kháng cự hoặc hỗ trợ, các vị thế mua bán của Bigboyz thường được xây dựng xung quanh các vùng HVN và khi HVN di chuyển thì các vùng LVN cần chú ý vì đây là khu vực có tính thanh khoản thấp nhất.

Trong phân tích VP, mỗi khi giá quay trở lại vùng HVN thì chúng ta cần theo dõi chặt chẽ diễn biến giá và khối lượng để xác định xem các Bigboyz sẽ hoạt động như thế nào và POC sẽ là điểm quan trọng nhất cần theo dõi.

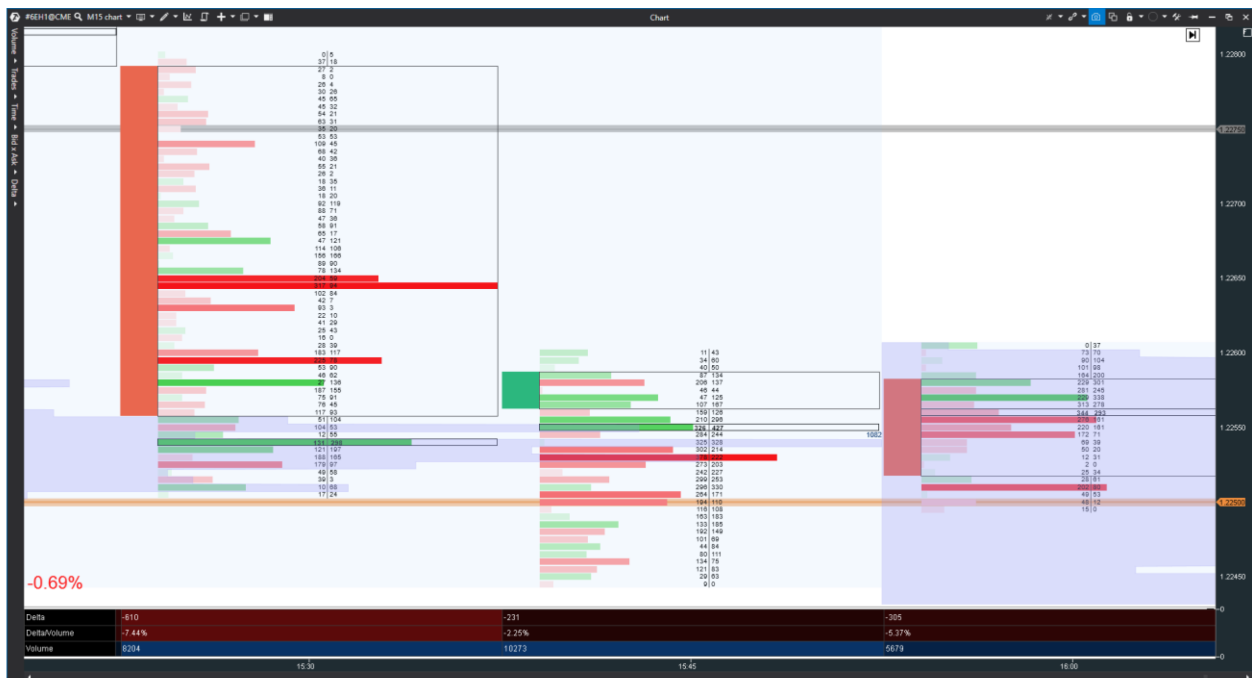


3/1/21

Volume Profile (phần 2)
Trong bài trước tôi đã đề cập tới 3 cấp độ quan trọng trong phân tích VP: HVN, LVN và POC. Cơ sở để hình thành nên các vùng cấp độ này là khối lượng mua bán tại các khu vực giá đó.
- Với khối lượng theo thời gian trên trục X (Volume bar) - khối lượng giao dịch trong 1 khoảng thời gian nhất định, nó cho thấy tại một thời điểm nhất định có 1 khối lượng giao dịch đã hoàn thành, thường thì thanh khối lượng cao hay tập trung sau khoảng 30 phút - 1h khi phiên giao dịch mới bắt đầu. Nó báo hiệu rằng hai phe Bò Gấu bắt đầu dàn trận, nhưng nó chưa cho biết phe nào sẽ chiến thắng do cuộc chiến trả giá chưa xong và hai bên chưa đồng ý chốt deal.
- Các Bigboyz sẽ giằng co nhau cho tới khi một trong hai phe kiệt sức, hoặc một trong hai phe kéo thêm đồng minh, khiến phe còn lại chịu thua buông bỏ, đây là giai đoạn Bigboyz xây dựng các vị thế của mình tạo lên các vùng HVN và POC
- Trong quá trình diễn biến của thị trường các vùng HVN và POC sẽ được chú ý nhiều nhất vì đó là chiến trường của 2 phe, mỗi khi giá quay trở lại khu vực HVN gần nhất thì phe thắng sẽ cố gẵng bảo vệ vị thế của mình và phe còn lại sẽ cố gắng đánh bại một lần nữa. Đó là cơ sở hình thành nên các vùng S/R.
Nơi diễn ra các vùng S/R quan trọng thường nằm gần nơi giá chẵn tròn số lớn, đơn giản vì các BB quản lý rất nhiều tài sản và họ cần các vùng giá dễ nhớ và các hợp đồng quyền chọn cũng thường tập trung quanh các khu vực giá này.
- Trong quá trình hình giao dịch các BB sẽ cố gắng che dấu vị thế lớn của họ bằng các chia nhỏ khối lượng để cố gắng lấp đầy giỏ hàng và tránh tạo ra các cú spike đột ngột. Tuy nhiên các mô hình VP trong quá trình xây dựng vị thế của họ sẽ tiết lộ dấu chân trên thị trường. Các mô hình được chú ý nhiều nhất là dạng chữ D, ,b P, I

- Mô hình chữ D biểu thị cho thấy đang có trạng thái cân bằng tạm thời, và các BB đang xây dựng vị thế của họ để chuẩn bị cho đợt di chuyển lớn.
- Mô hình chữ P báo hiệu cho một up-trend do các BB đang tích cực đẩy giá đi lên và hình thành 1 vùng HVN mới, mô hình này thường được nhìn thấy trong xu hướng tăng hoặc khu vực đáy của xu hướng giảm
- Mô hình chữ b - mô hình này thường có ý nghĩa ngược lại với mô hình chữ P, nơi thường thấy là trong xu hướng giảm hoặc đỉnh của xu hướng tăng
- Mô hình chữ I biểu thị một xu hướng mạnh mẽ, nơi ít có sự điều chỉnh giá do tính áp đảo của thị trường hoặc do một thông tin quan trọng được phát hành. Đây là mô hình yêu thích của tôi do yếu tố Volatility lớn

Với giao dịch intraday tôi thường phân tích chart M5 - M30, Swing H4, Long- term Daily
- Các bạn có thể tham khảo mô hình phân tích Gold future (Comex) + yếu tố market sentiment (COT report + USD) có thể thấy rằng giá vàng sẽ tiếp tục gia tăng trong tuần tới, và khu vực kỹ thuật kháng cự quan trọng sẽ nằm trong khu vực 1950 - 1960, hỗ trợ quan trọng ở khu vực 1880, 1850. Các đường màu xanh là các mức hđ Option cần chú ý.
- Trong hình khác là hình chụp diễn biến khối lượng giao dịch tăng vọt khi EUR giảm trở lại khu vực hội tụ các hợp đồng Option quan trọng 1.225 (EUR future - chart M15) và BTC tại thời điểm viết bài.





6/1/21

Nếu các bạn thực sự yêu thích phân tích khối lượng, nắm vững kiến thức và thực hành chăm chỉ thì với các kiến thức cơ bản trong series bài viết về khối lượng đã cho bạn thấy rõ sức mạnh của khối lượng trong phân tích kỹ thuật.

Tôi thường trao đổi về đề tài này với khá nhiều trader ở VN thì đa số nhận thấy có rất ít người đầu nghiêm túc vào khối lượng, phần đông chỉ thích học sao cho nhanh để kiếm tiền, và cái dễ học nhất và cũng có nhiều người đang train cho các bạn mới là các indicator và các loại mô hình giá. Thậm chí có 1 vài người có chứng chỉ CMT vân nói rằng phân tích khối lượng trong forex là điều viển vông bla bla bla ...

Như trong các bài viết trước tôi đã đề cập, giá, và mô hình giá nó giống như các chiêu thức trong môn võ học, ai muốn học để múa võ kiểu" Sơn Đông mãi võ" thì dễ, nhưng nếu muốn trở thành cao thủ thì phải khổ luyện công phu, nội lực rất khổ cực. Một võ sư nhỏ con múa võ rất giỏi nhưng nếu solo với 1 thằng cha bự con chuyên đi đánh nhau ăn tiền thì 80% là thua.
Trong PTKT thì khối lượng là nội công, là nền tảng cho sự chuyển động giá và nếu các bạn chăm chỉ luyện tập sẽ có khả năng phán đoán chính xác từ 70 - 80% nơi các Bigboyz hành động. Từ đó tăng khả năng có R:R tốt nhất, giảm thiểu rủi ro FOMO.
Nếu các bạn yêu thích phân tích khối lượng thì tôi sẽ mở group để anh em có sân chơi, tôi sẽ hướng dẫn cụ thể cách sử dụng các phần mềm chuyên dụng trong phân tích khối lượng. Anh em quan tâm hãy like, share (.) Nếu số lượng đủ trên 100 like, share (.) tôi sẽ mở group. Còn page chỉ là nơi tôi post các kiến thức cơ bản

7/1/21
Volume Profile - VP (phần 3)
POC (point of control) là mức giá quan trọng nhất trong phân tích VP, đặc biệt là POC daily.
Trong suốt quá trình biến động giá POC sẽ di chuyển theo khối lượng tại các điểm giá nhất định, nó cho thấy phe nào đang kiểm soát thị trường. Ví dụ trong hình 1 (6B) cho thấy sau khi mở cửa thị trường GBP bị đẩy xuống thấp, tuy nhiên POC không di chuyển theo giá, chứng tỏ Bigboyz chưa thực sự sẵn sàng cho việc giảm giá sâu hơn nữa. Mặt khác khi nhìn sang bên trái ta thấy giá đã chạm khu vực POC của 2 ngày hôm trước và khu vực POC tạm thời của mức giá thấp hôm qua, tức chạm vùng mua mạnh của đợt giảm giá hôm qua. Điều này cho thấy giá sẽ bị đẩy ngược trở lại POC trong ngày hôm qua (1.3615)
Theo dõi POC tiếp theo nếu POC dịch chuyển xuống dưới khi giá phục hồi sẽ cho tín hiệu rằng Bigboyz sẽ tham gia vào hành động giá và xác nhận bằng khối lượng.
Việc giao dịch sử dụng VP sẽ giúp chúng ta hạn chế rất nhiều các vị thế sai và khi kết hợp với phương pháp PA (price action) sẽ giúp chúng ta biết các điểm breakout có thực sự sẽ di chuyển giá hay đó chỉ là breakout giả.
Khi giá di chuyển tới điểm POC chúng ta hãy quan sát kỹ hành động giá và volume bar kết hợp với xu hướng giá, các mức S/R sẽ giúp ta có các vị thế vào lệnh với rủi ro thấp nhất và tránh được việc bị cuốn vào giá khi ta bỏ lỡ cơ hội giao dịch
Không có bất kỳ phương pháp nào đảm bảo tỷ lệ thắng 100% và luôn nhớ đặt SL.



11/1/21

VWAP trong phân tích khối lượng

Trong phân tích khối lượng có thể một số bạn mới chưa quen với việc giá di chuyển và mối liên quan tới khối lượng. Để giúp cho việc nhận định mức giá hiện tại có thực sự di chuyển do khối lượng hay không ta cần phân biệt giá thực và giá ảo (giá trị của tài sản).

Các bước nhảy giá là do thị trường đi tìm 1 mức cân bằng khối lượng mới, khi thị trường mất cân bằng thì giá sẽ có xu hướng dịch chuyển tới khu vực giá có khối lượng chào mua, chào bán lớn hơn (bid-ask) tới khi đạt được độ cân bằng. Nó giống như trò chơi bập bênh mà hồi nhỏ chúng ta hay chơi. Nếu 1 phe quyết tâm đẩy giá họ sẽ sử dụng khối lượng lớn để kéo/đẩy giá thị trường và họ tiếp tục gia tăng / thêm khối lượng để giữ cho giá tại vị thế đó được cân bằng nhằm triệt tiêu các vị thế đối ngược. Nếu bạn nào từng giao dịch chứng khoán lâu năm từ hồi còn lên sàn nhìn bảng điện tử để xem dư mua dư bán sẽ hiểu.

Trong các indicator có thể trợ giúp cho trader khi giao dịch khối lượng thì công cụ VWAP sẽ giúp ích cho việc nhận định giá di chuyển có sự trợ giúp của khối lượng hay không. VWAP (volume-weighted average price) - giá trung bình gia quyền theo khối lượng là tỷ lệ của giá trị được giao dịch trên tổng khối lượng giao dịch trong một khoảng thời gian cụ thể (thường là trong ngày).

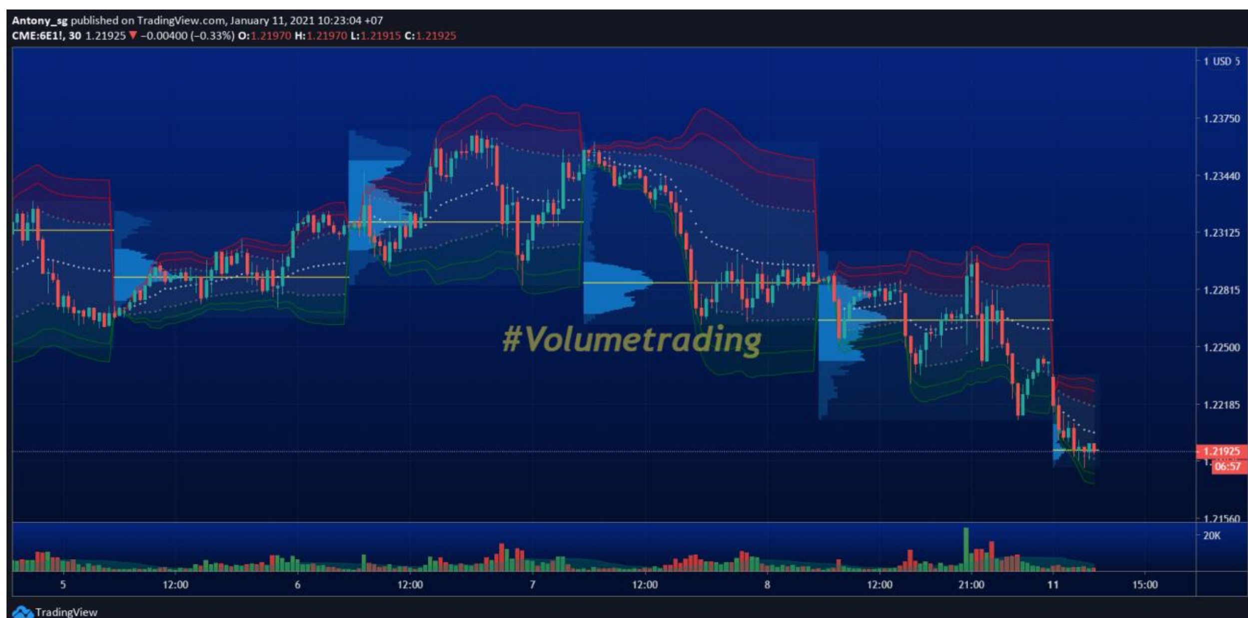
Điều này rất hữu ích cho các trader giao dịch theo trường phái Day trade hoặc scalping

Công thức tính các bạn có thể tự search trên google, tôi chỉ tóm tắt nguyên lý sử dụng VWAP như sau:

VWAP được tính toán dựa trên 3 nguyên lý: giá - khối lượng - thời gian, dựa trên sự di chuyển của VWAP với đồ thị giá nó cho biết giá trị hợp lý của tài sản giao dịch (cổ phiếu, hàng hóa, ngoại tệ ...) đang ở đâu.

Nếu giá phát triển quá cao so với VWAP, nó cho thấy tài sản bị định giá quá cao và nó sẽ có xu hướng giảm trở lại VWAP và ngược lại

VWAP tương tự như 1 đường trung bình, nhưng nó khác biệt so với các đường trung bình như SMA, EMA, các đường trung bình thường là kết quả của giá đóng cửa trung bình theo thời gian, còn VWAP nó dựa trên 3 tham số giá là cao-thấp-đóng cửa, thêm vào biến số khối lượng, nên nó cho thấy sự hợp lý của giá trị tài sản so với mức giá hiện tại, điều này thực sự quan trọng bởi khối lượng tạo lên sự khác biệt.
Khi bắt giá di chuyển kèo theo VWAP di chuyển theo thì ta có thể nhận thấy rằng giá được sự hỗ trợ của khối lượng, điều này cho thấy các Bigboyz thực sự tham gia vào quá trình đẩy giá.
Trường hợp giá di chuyển nhưng VWAP không di chuyển theo, nó cho thấy các Bigboyz không tham gia và giá sẽ thiếu động lực, nó buộc phải trở lại khu vực VWAP.
Trong thị trường sideway, giá có xu hướng di chuyển qua lại đường VWAP do thiếu động lực từ khối lượng
Trong giao dịch VWAP chúng ta có thể sử dụng độ lệch chuẩn để đo mức độ hợp lý của giá trị tài sản, các tham số của độ lệch chuẩn có thể tham khảo (1/1.28 - 2 - 2.5 - 3 - 4)
Đường trung tâm VWAP hoạt động như 1 thỏi nam châm để hút giá mỗi khi giá di chuyển quá xa và các độ lệch chuẩn hoạt động giống như các mức kháng cự và hỗ trợ
Tóm lại: Một xu hướng lành mạnh cần được thúc đẩy bởi khối lượng. Cần có một khoản tiền lớn (khối lượng) đằng sau việc di chuyển (cần các Bigboyz tham gia vào hành động đó), VWAP và độ lệch chuẩn của nó phản ánh điều đó vì nó có tham số khối lượng. Đó là lý do tại sao nên sử dụng VWAP trong việc phát hiện xu hướng.
Các bạn hãy tìm hiểu thật kỹ về công cụ này, nó sẽ giúp ích rất nhiều cho chúng ta trong việc quyết định có nên tham gia vào 1 hành động giá hay đứng ngoài. Hãy lưu ý độ dốc của VWAP, mức độ mở rộng của các band, hãy luyện tập kỹ cùng với Volume bar, volume profile



22/1/21

Good morning
Gold future (Comex) đang hình thành mô hình VP chữ B lớn. Mô hình ngụ ý 2 vùng giá tập trung khối lượng lớn sau khi giá vàng đi từ 1800 lên 1874. Ngày hôm qua đã có 1 đợt giằng co khá mạnh từ 1857 - 1874 và sáng nay phiên Tokyo đã giảm trở lại vùng 1860. Hiện tại mô hình VP cho đợt giảm ngày hôm qua cho thấy giá vẫn nằm dưới POC (1862). Hãy lưu ý với các lệnh Buy còn mắc kẹt trên mức giá này.
Giá đang trong phạm vi kênh giảm nhỏ.
Các mức HVN lớn cần lưu ý khu vực 1868, 1855, 1835
Quan điểm của tôi: Sell on rally. Giá có thể rớt trở lại khu vực 1855 hoặc sâu hơn là 1830 - 1835


23/1/21

Phân tích khối lượng không quá khó nếu bạn có kiến thức căn bản như Support - Resistance, supply - demand. Nếu không hiểu có thể đọc lại tất cả các bài viết của tôi trên page #grabtrader từ nhận biết thanh high volume bar đơn giản tới phức tạp + Volume profile + VWAP sẽ từ từ hiểu chuyển động của giá.
Cuối tuần rảnh rỗi tôi sẽ viết về Order flow (footprint) để anh em hiểu được khi "phẫu thuật" 1 cây nến ra sẽ thấy đó là nơi đấu tranh rất ác liệt giữa phe mua và phe bán, nếu nhìn nến đơn giản thì nó chỉ là cây nến bình thường và sẽ khó nhận biết được sự giằng co bên trong nó



24/1/21

Hello anh chị em
Báo cáo COT 3 tuần đầu năm 2021 vừa rồi cho thấy dòng tiền có dấu hiệu rời bỏ khỏi thị trường Vàng với các con số về mức thay đổi HĐ Open Interest (chỉ tính riêng các HĐ future trên sàn Comex) như sau:
Báo cáo 5/1: OI contracts +12,474
Báo cáo 12/1: OI contracts -13,350

Báo cáo 19/1: OI contracts - 14,280
Tổng cộng 3 tuần đầu năm -15,156 tương đương giảm -47,1 tấn
Báo cáo tuần 19/1 cho thấy các HĐ future của nhóm Non-comercial giảm cả vị thế long và short, tổng cộng nhóm đã bán 1,28 tấn, Comercial cũng giảm cả 2 vị thế. Nhóm Managed Money tính cả future + option giảm -0,85 tấn
Cách tính OI contracts quy ra Metric tones dựa trên giá trị OI thay đổi [(Long - short) x100] : 32,150 (phép tính giữ nguyên giá trị dấu +/-)
Báo cáo Option cho thấy kỳ hạn OGG1 hết hạn lúc 10am New York có 2 khu vực giá qua trọng 1850 - 1875, giá đóng cửa thứ 6 gần mức Max Pain (mức có lợi nhất cho Writer) nên khả năng thứ 2 phiên Mỹ sẽ có sự giằng co quanh 1850, bảng Option cũng cho thấy 2 vùng giá 1850 và 1875 vẫn là khu vực giá quan trọng trong tuần. Các HĐ trong tuần qua cho thấy tại 1875 có khối lượng thanh lý rất nhiều. Trong các bảng tôi có đánh dấu các ô màu cam
Về mặt kỹ thuật dựa trên S/R và VP thì khu vực đánh dấu trên biểu đồ là các khu vực quan trọng cần lưu ý.
Theo COT của CFTC cho tuần kết thúc vào ngày 19 tháng 1, các nhà đầu cơ đã tăng nhẹ vị thế Đô la Mỹ ròng ngắn hạn của họ lên 14.277 contracts, từ 13.907 hợp đồng được giữ trong tuần trước
Thứ 5 tuần sau sẽ có cuộc họp FOMC, kỳ vọng sẽ không nhiều trong hành động của Fed, tổng thống Biden dự kiến gặp khó khăn trong gói kích thích 1,900 tỷ USD
Quan điểm cá nhân tôi nghiêng về Bearish, tôi sẽ theo dõi chặt chẽ mức khối lượng tại khu vực 1850 nếu ngày thứ 2 đóng cửa dưới mức này để có đánh giá chính xác nhất.
Trade what you see.

GOLD - COMMODITY EXCHANGE INC.
FUTURES ONLY POSITIONS
Code-088691

AS OF: 2021-01-19
View Historical Data

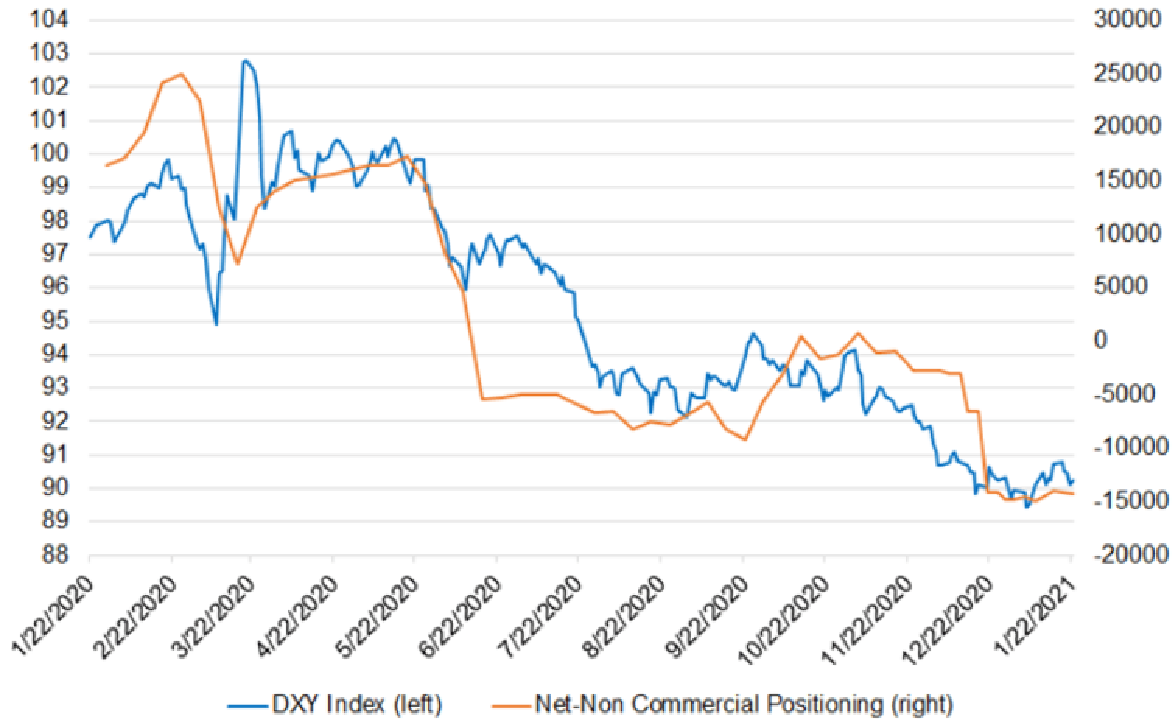
Non-Commercial			Commercial		Total		Non-Reportable	
Long	Short	Spreads	Long	Short	Long	Short	Long	Short
(CONTRACTS OF 100 TROY OUNCES)					Open Interest: 541,330			
307,507	60,869	73,648	99,444	386,911	480,599	521,428	60,731	19,902
Changes					(Change In Open Interest: -14,208)			
-5,710	-6,121	+113	-6,536	-9,370	-12,133	-15,378	-2,075	+1,170
Percent of Open Interest for Each Category of Traders								
56.8%	11.2%	13.6%	18.4%	71.5%	88.8%	96.3%	11.2%	3.7%
Number of Traders in Each Category					(Total Traders: 332)			
203	49	80	46	52	280	156		

GOLD - COMMODITY EXCHANGE INC. Code-088691
Disaggregated Commitments of Traders - Options and Futures Combined, January 19, 2021

	Open Interest	Producer/Merchant/ Processor/User		Swap Dealers			Managed Money			Other Reportables			Nonreportable Positions	
		Long	Short	Long	Short	Spreading	Long	Short	Spreading	Long	Short	Spreading	Long	Short
	(CONTRACTS OF 100 TROY OUNCES) Positions													
All	735,630	31,773	130,696	65,924	249,901	68,529	153,840	48,844	68,788	151,430	16,055	128,540	66,806	24,277
Old	735,630	31,773	130,696	65,924	249,901	68,529	153,840	48,844	68,788	151,430	16,055	128,540	66,806	24,277
Other	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
	Changes in Commitments from: January 12, 2021													
	-18,943	-1,353	1,013	-621	-4,706	-7,000	-5,022	-4,748	13,295	-2,373	-3,961	-13,270	-2,599	434
	Percent of Open Interest Represented by Each Category of Trader													
All	100.0	4.3	17.8	9.0	34.0	9.3	20.9	6.6	9.4	20.6	2.2	17.5	9.1	3.3
Old	100.0	4.3	17.8	9.0	34.0	9.3	20.9	6.6	9.4	20.6	2.2	17.5	9.1	3.3
Other	100.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
	Number of Traders in Each Category													
All	362	16	21	15	31	31	94	24	54	125	42	78		
Old	362	16	21	15	31	31	94	24	54	125	42	78		
Other	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		

Percent of Open Interest Held by the Indicated Number of the Largest Traders

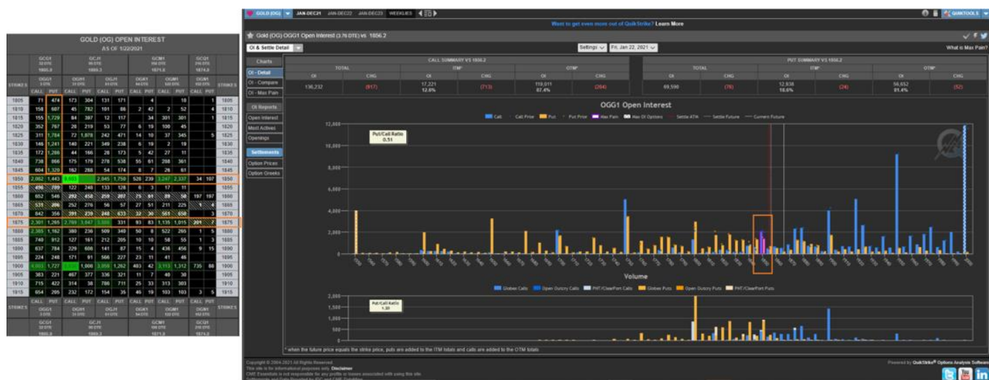
	By Gross Position				By Net Position			
	4 or Less Traders		8 or Less Traders		4 or Less Traders		8 or Less Traders	
	Long	Short	Long	Short	Long	Short	Long	Short
All	18.2	26.9	27.3	41.8	15.4	22.0	22.0	33.7
Old	18.2	26.9	27.3	41.8	15.4	22.0	22.0	33.7
Other	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0


DXY Index vs Net Non-Commercial Positioning:
January 22, 2020 to January 22, 2021
104
103
102
101
100
99
98
97
96
95
94
93
92
91
90
89
88
30000
25000
20000
15000
10000
5000
0
-5000
-10000
-15000
-20000
1/22/2020
2/22/2020
3/22/2020
4/22/2020
5/22/2020
6/22/2020
7/22/2020
8/22/2020
9/22/2020
10/22/2020
11/22/2020
12/22/2020
1/22/2021
DXY Index (left)
Net-Non Commercial Positioning (right)



EXPIRATION			VOLATILITY			SKEW		OPEN INTEREST			VOLUME		
SYMBOL	DTE	FUTURE	STRIKE	ATM	SHIFT SLIDE	25D RR (C-P)	25D QUIKSKEW®	TOTAL	P/C RATIO	MOST ACTIVE	TOTAL (TODAY* / PREV)	P/C RATIO	MOST ACTIVE
							Gold (OG) Totals** :	1,072,046 56,762 5.6%	0.33 -0.01		13,344 196,417 209,761	0.40	
OGG1	2.54 1/26/2021	1865.9 36.0 1.97%	1855 25	13.17 -1.72	-2.14 0.42	1.08 1.07	1.4p • 6.7C	205,822 -2,219 -1.1%	0.51 0.00	1875 C -1,149 -33.3%	1,744 70,046 71,790 49.3%	0.81	1900 C 5,240
OGH1	30.54 2/23/2021	1869.3 35.6 1.94%	1860 25	16.20 -0.26	-0.54 0.28	1.04 0.03	1.7p • 4.7C	225,319 1,438 0.6%	0.34 0.03	2750 C -2,443 -33.3%	0 39,802 39,802 27.3%	0.41	2500 C 5,576
OGJ1	60.50 3/25/2021	1869.3 35.6 1.94%	1860 25	17.20 -0.18	-0.41 0.23	1.52 0.16	2.4p • 6.3C	126,188 7,323 6.2%	0.35 -0.01	2000 C 1,118 12.4%	600 21,327 21,927 15.0%	0.36	2000 C 3,798
OGK1	93.50 4/27/2021	1871.8 35.3 1.92%	1860 25	17.50 -0.19	-0.37 0.18	1.97 0.29	3.4p • 7.7C	29,822 2,129 7.7%	0.36 -0.02	2000 C 891 39.8%	0 3,658 3,658 2.5%	0.23	2000 C 1,149
OGM1	121.50 5/25/2021	1871.8 35.3 1.92%	1860 25	17.89 -0.17	-0.35 0.18	2.21 0.27	3.6p • 8.6C	192,243 929 0.5%	0.27 0.00	2100 C -577 -4.0%	0 6,158 6,158 4.2%	0.35	2100 C 1,303
OGN1	151.50 6/24/2021	1874.0 35.0 1.90%	1865 25	18.25 -0.17	-0.33 0.16	2.30 0.31	3.7p • 8.8C	16,994 1,090 6.9%	0.20 0.02	2225 C 286 317.8%	250 2,143 2,393 1.6%	0.29	2050 C 502
							Totals:	796,388 10,690 1.4%	0.36 0.01		2,594 143,134 145,728	0.56	
SYMBOL	DTE	FUTURE	STRIKE	ATM	SHIFT SLIDE	25D RR (C-P)	25D QUIKSKEW®	TOTAL	P/C RATIO	MOST ACTIVE	TODAY* PREV TOTAL	P/C RATIO	MOST ACTIVE
EXPIRATION			VOLATILITY			SKEW		OPEN INTEREST			VOLUME		

* Today's volume represents electronic market (Globex and Block trades)
** Represents total of all Gold (OG) contracts that are included in the QuikStrike system (may not include some far-dated contracts)



29/1/21

Trong giao dịch Ngoại hối, dầu hay vàng ... chúng ta có thể sử dụng khối lượng trên thị trường future để xem xét động thái của các tổ chức lớn nhằm theo dấu họ. Với chứng khoán bạn chỉ cần nguồn dữ liệu đầy đủ từ các sàn chứng khoán

Làm thế nào bạn có thể sử dụng thông tin đó để tạo lợi thế cho mình khi các tổ chức lớn (Trader lớn - Bigboyz) đang giao dịch. Thị trường future chiếm khối lượng giao dịch từ 20 – 40% tùy theo sản phẩm giao dịch và đó cũng là nơi các tổ chức lớn thực hiện mua bán và đối ứng với khối lượng lớn. Các báo cáo COT mà các trader hay xem xét cũng lấy từ đây. Phân tích thanh khối lượng trên biểu đồ khá khó cho những người mới tham gia vào thị trường. Nhưng nếu bạn kết nối khối lượng với dữ liệu giá, bạn sẽ tìm thấy một số mức chính trên biểu đồ giao dịch và có thể phát hiện ra nơi các tổ chức lớn đang giao dịch. Các nhà giao dịch cá nhân (trader nhỏ) với số vốn nhỏ của họ không thể tạo ra sự khác biệt lớn trên thị trường chứng khoán hoặc ngoại hối, nhưng nếu bạn xác định được ở nơi các nhà giao dịch lớn đang giao dịch, bạn sẽ kiếm được nhiều lợi nhuận hơn, bởi vì giá có xu hướng tạo ra động thái lớn khi các tổ chức lớn tham gia thị trường. Đối với các giao dịch future, từ 2009 các giao dịch lớn trên CME đã bị phân tách nhỏ (rất hiếm khi nhìn thấy 1 lệnh giao dịch với khối lượng lớn trên 500 lots) nên việc theo dõi khối lượng đòi hỏi phải có rất nhiều kiến thức, kinh nghiệm, đồng thời phải sử dụng phầm mềm chuyên dụng để phân tích data.

Bạn nên sử dụng kết hợp volume bar, volume profile và các mô hình giá hoặc khu vực S/R (S/D), chuyên sâu hơn nữa là phân tích Open interest futures, options, forwards cùng báo cáo OTC

Nhưng trước khi tìm hiểu cách tìm ra số tiền lớn ở đâu, trước tiên chúng ta sẽ phải tìm hiểu khối lượng thực sự hoạt động như thế nào.

Giả sử một nhà đầu tư mua 200 cổ phiếu với giá 10 đô la, và 1 người khác bán 200 cổ phiếu với giá 10 đô la, do đó ta có khối lượng giao dịch ở 10 đô la là 200, không phải là 400. Rất nhiều nhà giao dịch mới nghĩ rằng khối lượng là 400, vì 200 cộng với 200 bằng 400.

Như tôi đã nói trước đây không dễ dàng giao dịch nếu chỉ phân tích dữ liệu khối lượng trên biểu đồ, bạn còn phải xem xét dữ liệu giá.
Dưới đây là cách sử dụng dữ liệu khối lượng và giá cả trên biểu đồ giao dịch:
1. Khi giá tăng và khối lượng cũng tăng, giá được coi là tăng khi có dòng tiền lớn tham gia.
2. Khi giá tăng, nhưng khối lượng giảm, giá được coi là tăng giá, nhưng chỉ có các trader nhỏ mua, dòng tiền lớn không tham gia.
3. Khi giá giảm, nhưng khối lượng tăng, giá được coi là giảm, do dòng tiền lớn rút ra.
4. Nhưng khi giá ngày càng giảm và khối lượng cũng giảm thì coi như giá đang có xu hướng giảm và chỉ có trader nhỏ bán. Các trader lớn không tham gia vào động thái đó, dòng tiền lớn không rút ra.

Để xem xét khối lượng tăng và giảm, không nên chỉ xem xét khối lượng của từng cây nến, mà còn là khối lượng của tất cả các cây nến lân cận.
Rất nhiều nhà giao dịch mới sẽ chỉ xem xét khối lượng của từng nến riêng lẻ mà họ đang thực hiện giao dịch, chứ không phải khối lượng của các nến lân cận khác.
Các trader mới được dạy rằng họ nên chú ý đến khối lượng khi thực hiện giao dịch. Nếu bạn tham gia vào một cây nến và khối lượng của nó tăng lên, đó là một dấu hiệu tốt, vì có thể có các nhà giao dịch khác cũng tham gia cùng và nếu khối lượng không tăng, lệnh giao dịch của bạn có thể sai. Đây là điều rất dễ gây hiểu lầm. Khi bạn tham gia giao dịch theo mô hình nến, không có quy tắc nào cho thấy các tổ chức và các nhà giao dịch lớn khác sẽ hoặc nên thực hiện các vị thế bằng cách nhìn vào cùng một cây nến. Vì vậy, khả năng khối lượng giao dịch tăng lên cùng lúc với vị thế là rất khó xảy ra. Nếu nhiều nhà giao dịch lớn quan tâm đến việc mua ở cùng khu vực với bạn, bạn sẽ thấy khối lượng giao dịch gần khu vực vào lệnh của bạn tăng lên, chứ không phải chỉ trên nến vào lệnh của bạn.
Vì các tổ chức lớn giao dịch với khối lượng rất lớn, nên giá có xu hướng tạo ra những biến động lớn đột ngột khi những người chơi lớn tham gia thị trường. Trên các khung thời gian nhỏ hơn, những chuyển động đột ngột này có thể dễ dàng cắt lỗ của bạn. Nhưng nếu bạn phát hiện ra sự gia tăng khối lượng vào đúng thời điểm, bạn nên tận dụng cơ hội này bằng cách tham gia vào một vị thế. Nếu bạn gặp may mắn, bạn sẽ có lợi nhuận rất cao.
Một trong những tình huống mà việc tìm kiếm khối lượng cao hơn thực sự hữu ích, là trong quá trình hình thành các mô hình nến nhấn chìm (engufing). Mô hình nhấn chìm tăng giá là mô hình nến hình thành khi nến giảm nhỏ hơn trung bình được theo sau bởi một nến tăng giá lớn. Cây nến tăng lớn này bao phủ hoặc nhấn chìm toàn bộ phần thân của cây nến trước. Mô hình nhấn chìm tăng cho thấy khả năng giá tăng cao hơn. Mô hình nhấn chìm giảm giá đối lập với mô hình nhấn chìm tăng giá.
Không phải tất cả các mô hình nhận chìm đều có thể giao dịch nếu bạn không quan sát khối lượng (rất nhiều trader bị đu đỉnh/đáy bởi giao dịch theo nến engufing một cách mù quáng)
Tôi sẽ cho bạn một ví dụ: Giả sử, bạn đang đợi giá đạt đến mức hỗ trợ, để chắc chắn rằng mức hỗ trợ này có khả năng đảo chiều, bạn nên nhìn vào khối lượng.
Khi giá đang giảm xuống vùng hỗ trợ của bạn, bạn sẽ thấy khối lượng giảm. Khi nó chạm vào vùng hỗ trợ của bạn, một mô hình nhấn chìm tăng giá sẽ được hình thành. Mô hình Engulfing là một dấu hiệu tốt vì nó cho thấy sự đảo chiều. Nhưng điều này thậm chí còn tốt hơn, bởi vì mô hình nhấn chìm tăng giá này có khối lượng cao hơn trung bình trên cây nến tăng.
Điều này có nghĩa là có nhu cầu mua tăng cao gần vùng hỗ trợ mà bạn đã đánh dấu. Sau mô hình nhấn chìm này, khả năng cao là giá sẽ tăng cao hơn.

Nếu bạn thấy giá đi xuống về phía hỗ trợ của mình với khối lượng lớn hơn. Nó cho thấy một áp lực giảm giá. Nói một cách dễ hiểu, vẫn có nhu cầu bán gần vùng hỗ trợ của bạn. Nếu đúng như vậy, khả năng vùng hỗ trợ của bạn hoạt động và giá đảo chiều là rất thấp.
Khối lượng cũng có thể giúp bạn xác định các điểm đột phá giả. Nếu giá ở trong một phạm vi trong một thời gian với khối lượng thấp và bạn thấy một điểm đột phá với khối lượng trung bình, thì điều đó cho thấy khả năng đó là một điểm đột phá sai. Nhưng nếu một cây nến thoát ra khỏi phạm vi có khối lượng cao hơn mức trung bình, thì khả năng giá di chuyển xa hơn theo hướng bứt phá trở nên cao hơn.
Nếu bạn đang giao dịch bằng cách sử dụng khối lượng, đây là một số điểm quan trọng bạn cần lưu ý.
1. Khối lượng có thể được sử dụng để phân tích xu hướng thị trường, đảo chiều và các mức hỗ trợ và kháng cự của bạn. Hơn nữa, khối lượng cũng có thể được sử dụng để đảm bảo pullback trong một xu hướng, là pullback thực tế và không phải là đảo chiều.
Trong một xu hướng tăng, nếu giá tăng cao hơn và đưa ra một đợt pullback với khối lượng thấp hơn, đó là dấu hiệu cho thấy giá vẫn có thể tăng lên. Nhưng nếu pullback có khối lượng cao hơn trung bình, nó có thể cho thấy sự bắt đầu của một xu hướng giảm mới.
2. Khối lượng cũng có thể được sử dụng để tìm tiền thông minh và tiền lẻ. Nếu giá tăng và khối lượng tăng, đó là một xu hướng tăng. Nếu giá tăng, nhưng khối lượng giảm. Đó là một xu hướng tăng, nhưng không có tiền thông minh tham gia. Nếu giá đang giảm nhưng khối lượng lại tăng lên thì đó là một xu hướng giảm. Nếu giá giảm, nhưng khối lượng cũng giảm, đó là xu hướng giảm với tiền lẻ. Các tổ chức lớn không tham gia vào động thái này.
3. Tránh giao dịch vào những ngày khối lượng thấp và thực hiện giao dịch vào những ngày khối lượng cao hơn.
4. Khối lượng có thể cao hơn rất nhiều và chuyển động giá có thể biến động nhiều hơn đối với cổ phiếu, ngoại hối trong các sự kiện hoặc thông báo tin tức. Nếu bạn giao dịch trên các khung thời gian nhỏ hơn, bạn nên theo dõi những bản tin tức này có tác động đến sự biến động.
5. Khối lượng thường cao hơn khi các thị trường lớn mở và đóng cửa, và thấp hơn trong giờ ăn trưa. Nếu bạn là người mới bắt đầu, có lẽ bạn nên tránh giao dịch trong giờ ăn trưa và chỉ giao dịch khi thị trường đang có xu hướng với khối lượng lớn.

9/2/21

Khi giao dịch các sản phẩm tài chính, hoặc hàng hóa trên thị trường future, thì việc quan trọng nhất là nhận diện dòng tiền vào hay ra khỏi thị trường đó. Khối lượng cho ta biết các đơn vị hợp đồng đang được trao đổi tích cực hay suy giảm, Hđ Mở - Open interest contracts (OI)cho ta biết dòng tiền ra hay vào thị trường và mối quan tâm của thị trường với mức giá đó.
Các quy tắc chung về mối quan hệ giữa giá cả, khối lượng và hđ Open interest như sau:
1/ Giá tăng + khối lượng tăng + Oi tăng => thị trường có xu hướng tăng mạnh mẽ
2/ Giá tăng + khối lượng giảm + OI giảm => báo hiệu sự xu hướng tăng suy yếu
3/ Giá giảm + khối lượng giảm + OI giảm => thị trường có xu hướng giảm mạnh mẽ
4/ Giá giảm + khối lượng tăng + OI tăng => báo hiệu xu hướng giảm suy yếu
Có 8 quy tắc về phân tích OI các sản phẩm trên sàn tương lai mà bất kỳ trader nào cũng phải hiểu và ghi nhớ:

1/ Nếu giá và OI cũng đang tăng với tốc độ nhanh hơn mức trung bình theo mùa trong 5 năm, thì đây là một dấu hiệu tăng giá . Có nhiều người tham gia thị trường (dòng tiền vào), liên quan đến việc tăng cường mua hoặc bổ sung và bất kỳ giao dịch mua nói chung đều mang tính chất tích cực.
2/ Nếu hđ OI mới không tăng hoặc đi ngang, kèm theo xu hướng tăng cả về giá và số lượng hđ OI, hãy coi đây là dấu hiệu cảnh báo về một đỉnh sắp xảy ra .
3/ Tỷ lệ hđ OI cao ở các đỉnh thị trường là một tín hiệu giảm giá nếu giá giảm đột ngột vì điều này sẽ buộc nhiều vị thế Mua yếu thế phải thanh lý. Đôi khi, những điều kiện như vậy tạo ra một vòng xoáy kích thích bán tháo làm thị trường đi xuống.
4/ Hđ OI cao bất thường hoặc kỷ lục trong thị trường tăng giá là một tín hiệu nguy hiểm. Khi xu hướng tăng của Hđ OI bắt đầu đảo ngược, hãy kỳ vọng xu hướng giảm sẽ bắt đầu.
5/ Hđ OI tăng trong quá trình hợp nhất, thì khi giá bứt phá khỏi phạm vi giao dịch sẽ mãnh mẽ hơn nhiều. Điều này là do nhiều nhà giao dịch có vị thế vào sai phía của thị trường (thua lỗ), khi giá bứt phá, những nhà giao dịch này buộc phải đóng vị thế của họ, sẽ kích thích thị trường di chuyển nhanh hơn. Có thể nói rằng sự gia tăng Hđ OI trong quá trình hợp nhất càng lớn thì tiềm năng cho động lực bứt phá tiếp theo càng lớn.
6/ Giá tăng và Hđ OI giảm với tỷ lệ lớn hơn mức bình thường theo mùa là xu hướng giảm. Điều này là do nhu cầu “short covering” (mua bù thiếu), không phải nhu cầu cơ bản, đang thúc đẩy xu hướng giá tăng. Trong những trường hợp này, tiền đang chảy ra khỏi thị trường. Do đó, khi lượng dư "short covering” đã hết, giá sẽ giảm.
7/ Nếu giá đang giảm và hđ OI tăng hơn mức trung bình theo mùa, điều này cho thấy rằng các vị thế bán mới đang được mở, nếu quá trình này tiếp tục gia tăng nó sẽ thúc đẩy thị trường giảm giá, nhưng khi lực bán suy yếu thị trường sẽ chuyển sang tăng giá.
8/ Giá và Hđ OI cùng giảm, nó cho thấy tâm lý của các nhà giao dịch đang chán nản với các vị thế mua . Khi xu hướng này tiếp tục, đó là một dấu hiệu giảm giá. Khi Hđ OI ổn định ở mức thấp, việc thanh lý kết thúc và giá có thể phục hồi trở lại.

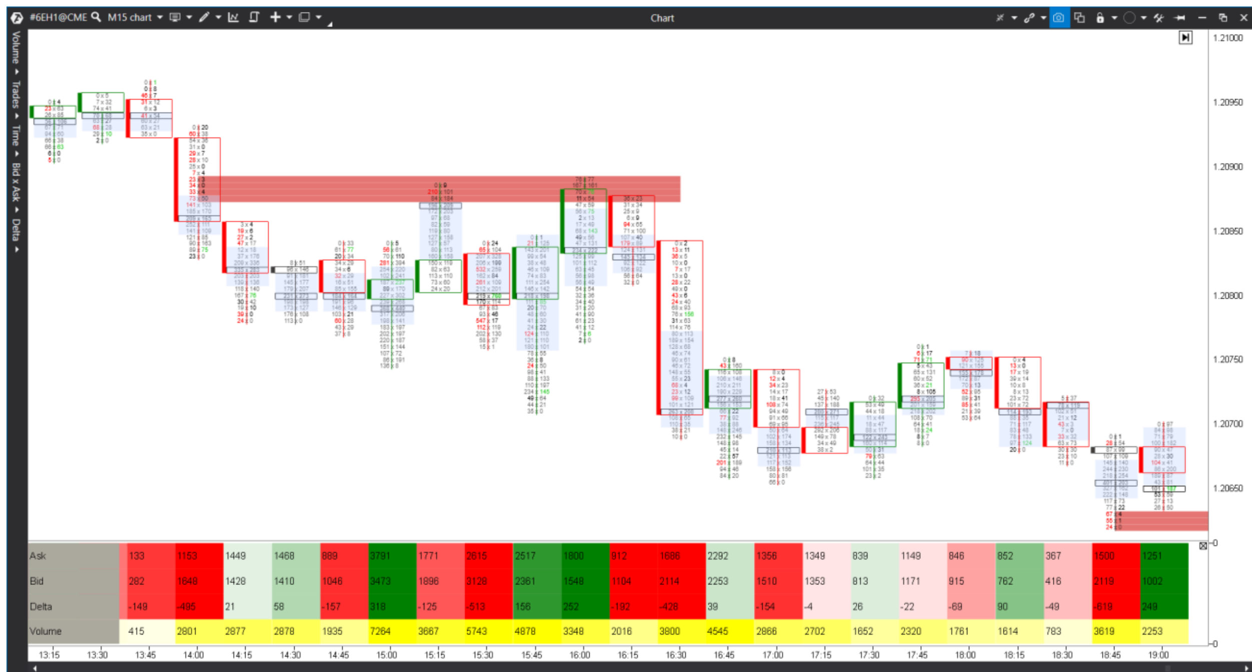
19/2/21
Với các anh chị em đã tìm hiểu về phân tích khối lượng thì serries giao dịch theo dòng lệnh sẽ dễ hiểu, còn những bạn nào mới tìm hiểu thì hãy đọc lại từ đầu các bài viết trên page để có cái nhìn có bản nhất. Vì đây là kiến thức chuyên sâu hơn nên sẽ khó hiểu với các bạn mới.
Giao dịch theo dòng lệnh là một khái niệm xuất hiện khá mới cho các retail trader từ khi kỹ thuật máy tính và tốc độ đường truyền internet phát triển, tuy nhiên các trader quỹ hay ngân hàng thì họ không lạ lẫm khái niệm này. Tất cả các diễn biến trên giá và khối lượng đều xuất phát từ đây, các giao giao dịch lừa đảo, săn stoploss cũng xuất phát từ đây. Nếu bạn không có kiến thức và hiểu về cách thức giao dịch theo dòng lệnh thì bạn sẽ không thể hiểu được tại sao giá đang đi lên hay đi xuống tự nhiên quay ngoắt ngược lại chạy 1 mạch không dừng.
Tất cả chúng ta đều biết có 1 số loại lệnh giao dịch trên thị trường như: lệnh trực tiếp, lệnh chờ mua, chờ bán, lệnh dừng lỗ.
Cơ chế hoạt động của thị trường là 1 cuộc đấu giá của những người khổng lồ : thể chế, ngân hàng, quỹ ... rồi mới tới retail trader. Chúng ta là retail traders, tầng cuối cùng trên bảng tổng sắp trader nên nếu chúng ta không hiểu những người khổng lồ làm gì thì tôi dám chắc tất cả sẽ thua lỗ vì chúng ta đang hoạt động với đôi tai và đôi mắt bị bịt kín (blind trading)

Việc đọc các dòng lệnh rất khó, nhưng không phải không thể nếu các bạn nắm được các nguyên lý cơ bản của nó.
Dòng lệnh đơn giản chỉ là các con số, nó giống như 1 dòng người tham gia giao thông đông đúc trong hỗn loạn, nếu bạn không biết tìm ra người dẫn đầu thì sẽ bị lạc trong mê cung các con số.
Giao dịch để trải nghiệm thì rất đơn giản, nhưng giao dịch để kiếm sống cực kỳ khó khăn, tỷ lệ sống sót sau 2 năm cực kỳ thấp nếu bạn không có nguồn thu bổ xung.
Sơ lược đầu tiên để hiểu về dòng lệnh là khái niệm Bid ,ask, khái niệm này chắc ai cũng hiểu.
Khái niệm thứ 2 là các giao dịch chủ động và thụ động, giao dịch chủ động là các lệnh thị trường, giao dịch thụ động là các lệnh giới hạn mua/bán
Lệnh lớn (big trade) là các lệnh có kích thước lớn hơn bình thường (tùy theo từng thị trường) vd với Vàng các lệnh đơn lẻ trên 50 lot, các lệnh tích lũy trên 150 lot.
Cơ chế khớp lệnh là trên bảng DOM (deep of markets) có các lệnh chờ Bid - Ask để dẫn dụ giá, giá di chuyển là do khối lượng khớp các lệnh trực tiếp đẩy các bước giá tới các lệnh chờ tiếp theo tới khi khớp hết toàn bộ. Sau khi khớp xong thì giá sẽ dừng lại chờ các lệnh mua hay bán trực tiếp mới. Khi thị trường cân bằng thì giá có xu hướng đi rất chậm chạp và khối lượng được tích lũy lớn dần. Nếu thị trường có rất nhiều lệnh Ask với khối lượng lớn ở phía trên giá mà các lệnh Buy trực tiếp đổ vào sẽ làm kích hoạt trạng thái mấy cân bằng và giá liên tục bị đẩy lên các mức cao mới cho tới khi khớp hết các lệnh, trong điều kiện như vậy phe Buy phải tiếp tục triệt tiêu các lệnh bán thì sẽ giữ cho trạng thái thị trường cân bằng và khi đó sẽ thiết lập mặt bằng giá cao mới hơn. Trường hợp ngược lại phe Buy không giữ được trạng thái cân bằng và gặp khối lượng lệnh chờ bán khổng lồ phía trên sẽ làm giá giảm nhanh chóng trở lại, khi đó phe Buy sẽ trở thành bên bị mắc kẹt (traped)
Bài đầu tiên của serries mới tạm thời như vậy để anh chị em tìm hiểu từ từ. Với các bạn mới tham gia thị trường sẽ rất khó hiểu, nhưng cũng sẽ là 1 lợi thế là các bạn sẽ được tiếp cận với các kiến thức nền tảng cơ bản nhất để hiểu cách thị trường hoạt động tránh sa đà vào việc đi tìm bí kíp giao dịch. Tôi xin nói thẳng không có bí kíp nào đảm bảo thành công 100% trong giao dịch, khi bạn đã hiểu cách thức nó vận hành bạn sẽ thấy sợ nó, lúc đó bạn sẽ tìm thấy lối đi cho mình theo kẻ mạnh, tránh lao đầu vào khi thị trường đang quyết đấu
Tôi không nhớ đã đọc ở đâu đó về Bigboyz trong thị trường nhưng đại ý như sau: "kẻ mạnh luôn ẩn mình và rất giỏi cách ném xương"
Happy trading!
#Grabtrader

Bid	Ask
24	48
77	90
141	114
114	83
28	43
20	85
24	73
90	177
159	116
145	262
256	294
271	219
181	289
268	207
215	207
114	215
385	161
212	129
48	64
49	34
7	104
6	44
22	81
100	89
25	84
79	145
136	164
184	191
254	310
280	277
289	219
328	241
294	260
128	117
95	67
10	89
125	170
95	161
100	78
15	45
68	64
126	160
207	237
145	172
238	168
314	150
195	185
105	187
263	352
320	155
84	48
14	4

Ask	7728
Bid	7472
Delta	256
Delta/Volume	1.68%
Volume	15200

Bid	Bid trades	Price	Ask trades	Ask
		1.21135		
		1.21130		
		1.21125		
		1.21120		
		1.21115		
		1.21110		
		1.21105		
		1.21100		
		1.21095		
		1.21090		
		1.21085		
		1.21080		
		1.21075		
		1.21070		
		1.21065		
		1.21060		81
		1.21055		99
		1.21050		56
		1.21045		40
		1.21040		47
		1.21035		51
		1.21030		67
		1.21025		62
		1.21020		48
		1.21015	7	19
	6	1.21010		
35		1.21005		
41		1.21000		
39		1.20995		
54		1.20990		
46		1.20985		
53		1.20980		
46		1.20975		
58		1.20970		
48		1.20965		
56		1.20960		
		1.20955		
		1.20950		
		1.20945		
		1.20940		
		1.20935		
		1.20930		
		1.20925		
		1.20920		
		1.20915		
		1.20910		
		1.20905		
		1.20900		
		1.20895		
		1.20890		



20/2/21

Để hiểu được cách dòng lệnh (orderflows) hoạt động trên thị trường chúng ta cần hiểu về cách thức để thị trường hoạt động:

Các nhân tố tham gia vào hoạt động thị trường bao gồm: nhà tạo lập thị trường (market maker - MM), sàn giao dịch, các nhà giao dịch (traders)

Nhân tố quan trọng nhất để tạo thanh khoản cho thị trường hoạt động là MM, họ có thể là tổ chức hoặc cá nhân, họ là thành viên của sàn giao dịch, họ là bên cung cấp các báo giá Mua và Bán trên thị trường với các mức giá và khối lượng nhất định. Họ có thể báo giá thay mặt khách hàng hoặc tự thực hiện. Các sàn môi giới sẽ nhận các báo giá từ nhiều nguồn MM để cung cấp cho khách hàng giao dịch tạo lên độ sâu thị trường (depth of market). Các nhà giao dịch là bên sẽ thực hiện các lệnh mua bán từ MM tạo lên khối lượng giao dịch cho thị trường.

MM sẽ báo giá cho thị trường 1 mặt hàng nào đó ví dụ chứng khoán với các bước giá Mua - Bán có sự chênh lệch gọi là Bid - Ask (Offer). Bid là giá chào mua, Ask (offer) là giá chào bán.

Ví dụ MM cung cấp báo giá về chứng khoán như sau : $10,00 - $10,05 ; 100 x 400 trên bảng có nghĩa là họ Bid (chào mua) 100 cp tại giá $10,00 và Offer (chào bán) 400 cp tại giá $10,05. Trong báo giá như trên ta thấy MM hưởng chênh lệch $0,05 giá trị chênh lệch trên 1 cp sau khi giao dịch thành công. Họ chính là bên cung cấp thanh khoản và chiều sâu cho thị trường, họ hưởng lợi trên chênh lệch bid-ask. Ngoài cung cấp báo giá, MM cũng tự thực hiện các lệnh giao dịch trên thị trường gọi là giao dịch chính, đây chính là nguồn gốc của các hành vi thao túng trên thị trường.

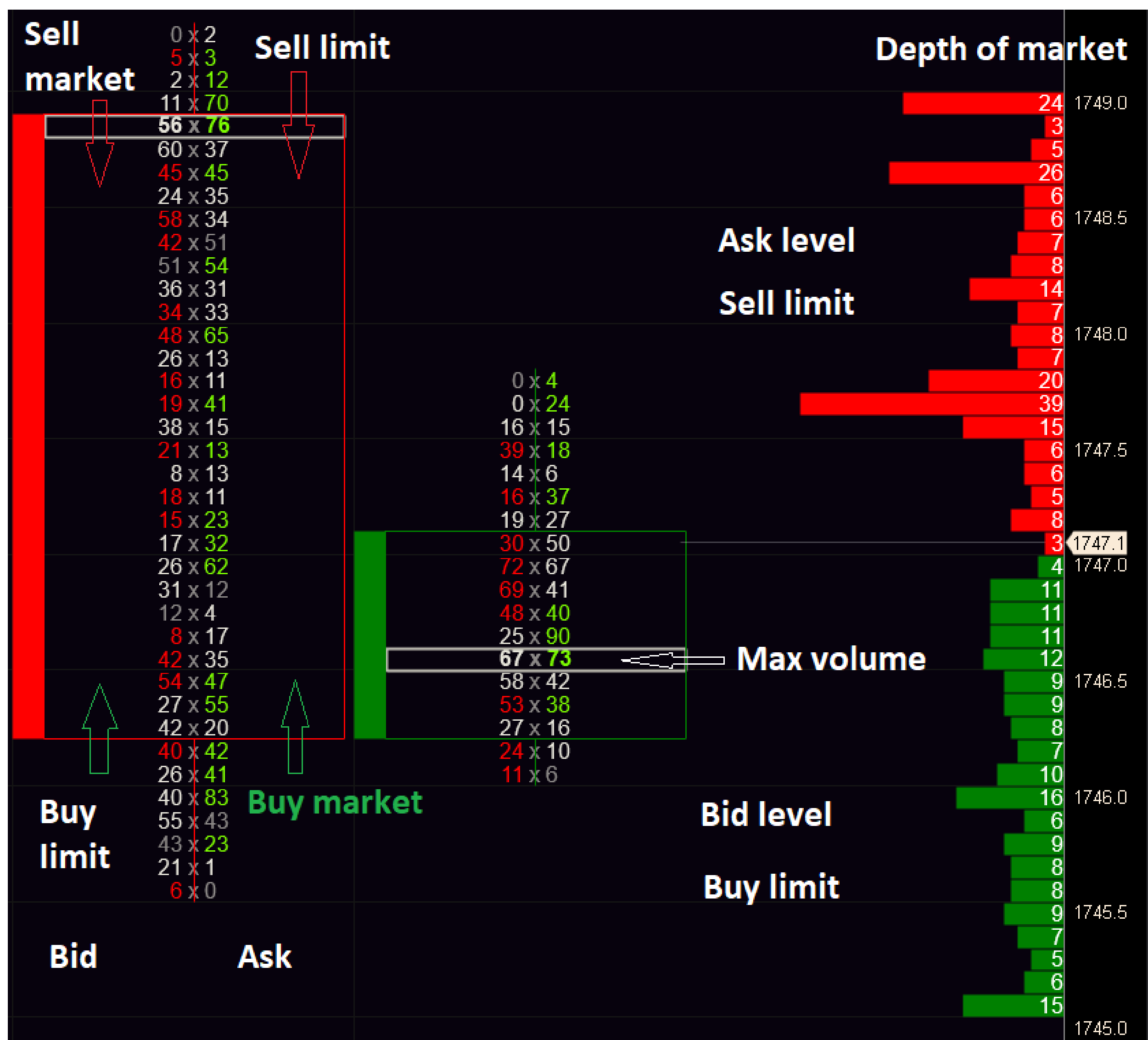
Nhiều MM chính là các công ty môi giới, nhiệm vụ của họ là cung cấp thanh khoản cho thị trường hoạt động, tuy nhiên do độ rộng lớn của thị trường lên phần lớn MM làm việc cho các khách hàng lớn của họ, các thể chế lớn, công ty đại chúng, các quỹ giao dịch ...

Việc tham gia của các nhà tạo lập thị trường sẽ giúp cho thị trường tài chính lưu thông suôn sẻ bằng cách giúp các nhà đầu tư, trader mua bán dễ dàng hơn. MM phải cam kết báo giá liên tục các mức giá mà họ sẽ mua (Bid) và sẽ bán (Ask - offer), đồng thời họ cũng phải báo khối lượng giao dịch và tần suất thời gian của báo giá tại mức giá chào mua chào bán tốt nhất (Best bid and best offer - BBO). MM phải luôn bám sát các thông số này kể cả trong điều kiện thị trường biến động thất thường để tạo điều kiện thuận lợi cho giao dịch suôn sẻ. MM là thành viên của các sàn giao dịch, cần có giấy phép hoạt động và chịu sự quản lý của các cơ quan chuyên trách nhằm tránh các hành vi gây tổn hại thị trường.
Happy trading!
#Volumetrading

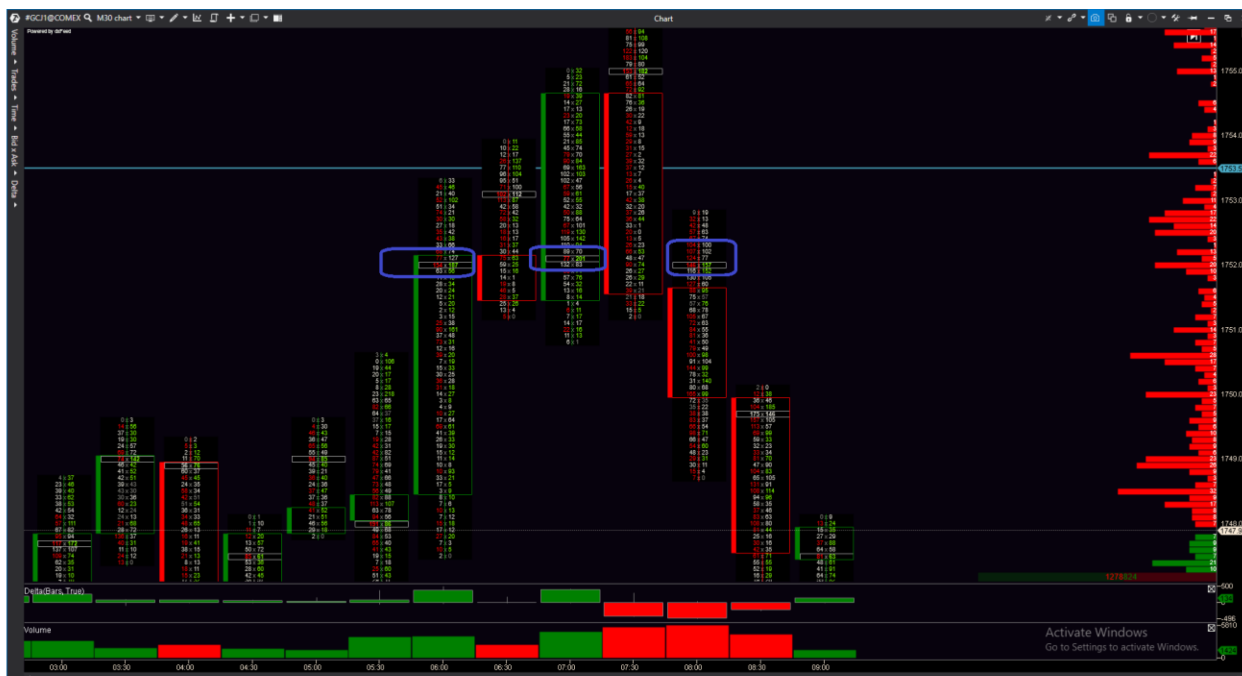
1/3/21

Biểu đồ dấu chân (footprint)
Phần tiếp theo chúng ta phân tích biểu đồ dấu chân để hiểu các hành vi giao dịch bên trong nội tại một cây nến. Với phần đông trader khi nhìn vào đồ thị nến thông thường sẽ luôn tự hỏi các nhà giao dịch lớn (Bigboyz) trên thị trường đang làm gì? Mua hay bán?
Với biểu đồ dấu chân khi nhìn vào cấu trúc một cây nến ta có 2 thành phần tham gia giao dịch: giao dịch chủ động và giao dịch thụ động
1/ Giao dịch thụ động: lệnh giao dịch ở các mức giá nhất định và chờ đợi thị trường hấp thụ lệnh mua bán với khối lượng và mức giá cụ thể
2/ Giao dịch chủ động: lệnh mua bán ngay lập tức theo giá thị trường và không chờ đợi ở các mức giá cố định.
Trong cấu trúc thi trường luôn có 2 dòng lệnh là Bid và Ask (offer), trên bảng DOM (depth of market), Ask level thể hiện màu đỏ - đây là các lệnh Sell limit, Bid đươc thể hiện màu xanh - lệnh Buy limit.
Ask– sell limit là các mức giá với khối lượng nhất định được chào bán bởi các thành phần tham gia thị trường như: market maker, tổ chức lớn, traders ... các mức level lớn thường của các nhà giao dịch lớn, đôi khi nó là tập hợp lệnh của nhiều nhà giao dịch. Các mức này khi chạm giá thị trường sẽ được hấp thụ bới các nhà giao dịch chủ động, nếu khối lượng mua lớn hơn khối lượng ask giá sẽ di chuyển lên mức level cao hơn, tới khi hấp thụ toàn bộ, nếu khối lượng mua không đủ thì giá sẽ không di chuyển lên mức tiếp theo và khối lượng ask sẽ bị trừ đi phần đã hấp thụ. Với Bid thì ngược lại.
Trong cấu trúc 1 cây nến ta cũng thấy 2 cột Bid và Ask, tuy nhiên ta cần phân biệt rõ là Bid không phải hoàn toàn là các lệnh bán và Ask cũng không phải hoàn toàn là các lệnh mua. Bid bao gồm cả các lệnh Bid trong bảng DOM (lệnh thụ động - buy limit) và Sell market (lệnh trực tiếp - sell), ở đây Bid bao gồm cả lệnh chủ động và thụ động, với ask thì ngược lại. Các lệnh buy - sell được khớp sẽ chênh lệch nhau 1 dòng (spread), chênh lệch khối lượng đủ lớn gọi là imbalance , tỷ lệ tùy theo cài đặt theo sở thích từng người, thường mức chênh lệch từ 150 – 300%. Delta = Ask – Bid.
Khi phân tích biểu đồ dấu chân (footprint) ta cần chú ý mức độ imbalance, vùng HVN và POC, imbalance cho thấy mức độ quan tâm của thị trường, HVN và POC cho biết các mức giá quan

trọng, nếu các mức giá quanh HVN và POC cả Bid và Ask đều lớn thì nó cho thấy đây là khu vực tranh chấp của 2 bên.
Trong bài trước tôi đã nói về vai trò của MM trong thị trường và cách thức họ đưa lệnh giao dịch ra thị trường, trong DOM có cả khối lượng lệnh giới hạn của BB và MM, thậm chí khối lượng đó là tập hợp của nhiều trader nhỏ hơn tại cùng 1 mức giá. Do đó nếu bạn chỉ mới tìm hiểu về biểu đồ dấu chân và giao dịch theo dòng lệnh (orderflows) bạn có thể sẽ dễ bị nhầm lẫn khi đọc DOM.
Khi phân tích đồ thị dấu chân cần phải xác định các vùng giá hỗ trợ/ kháng cự để xem xét khối lượng Bid, Ask trên DOM và trên nến (cluster) để xác định các vùng giá quan trọng, nếu trên DOM xuất hiện liên tục các khối lượng lệnh limit lớn và sau khi thị trường hấp thụ giá không có di chuyển mạnh thì có thể thấy MM hoặc BB đang thực hiện các lệnh giới hạn và khả năng thị trường đảo chiều khá cao. Trong trường hợp các khối lượng lớn trên DOM bị hấp thụ và thị trường không có dấu hiệu dừng lại hoặc di chuyển qua chậm chạp thì khả năng có lệnh lớn đó chỉ là tập hợp của các trader nhỏ hơn nên họ không đủ lực xoay chiều thị trường và thị trường đang bị các BB hoặc MM chi phối, khi giá đi đủ xa chạm các mức margin call sẽ kích hoạt các lệnh dừng lỗ hàng loạt.
Nếu các nến khác nhau trong cùng 1 khu vực giá mà xuất hiện các vùng HVN hoặc POC thì khả năng thị trường đang báo hiệu một mức cản tiềm năng và ta cần đánh dấu khu vực giá đó lại để cảnh báo.
(serries còn tiếp trong các phần sau ...)
Happy trading!



Sell market
Sell limit
Depth of market
Ask level
Sell limit
Max volume
Buy limit
Buy market
Bid level
Buy limit
Bid
Ask



8/3/21

Tiếp theo tôi sẽ giải thích cho các bạn hiểu về orderflow trading (OFT) và cách sử dụng trong giao dịch hàng ngày.
OFT là phương pháp sử dụng các dữ liệu về khối lượng và độ sâu thị trường (depth of market) để xác định các khu vực giá có độ quan tâm cao của thị trường (balance) và khu vực mất cân bằng (imbanlance) hoặc stoploss hunt.
Nền tảng của biểu đồ dấu chân là khối lượng giao dịch, từ đó các nhà giao dịch phát triển ra các khái niệm (concept) giao dịch khác nhau dựa trên khối lượng như: volume bar, volume profile ...
Để học cách phân tích OFT bạn cần có phần mềm chuyên dụng và nguồn dữ liệu uy tín.
Trong giao dịch ngoại hối và hàng hóa CFD thì phân tích khối lượng giao dịch sẽ không đầy đủ như trong chứng khoán, dó đó ta có thể sử dụng khối lượng trên thị trường future để phân tích, tuy nhiên cần nhớ rằng khối lượng này không đại diện 100% cho toàn bộ thị trường nên chúng ta chỉ tập trung phân tích khi giá chạm các vùng kháng cự, hỗ trợ, option level, và các khu vực giá chẵn tròn ...
Tại sao chúng ta khi giao dịch fx, dầu hay vàng CFD phải quan tâm tới số liệu của thị trường future và option? Vì đây là thị trường tập trung và có quy tắc, có luật lệ ràng buộc các nhà giao dịch nên nó có tính pháp lý rất cao, đây là nơi có các nhà giao dịch lớn tham gia nên khối lượng của nó sẽ phản ánh khá chân thực ý chí của họ trong thị trường. Báo cáo COT chúng ta đọc hàng tuần cũng lấy số liệu từ đây.
Vậy OFT có giúp ích gì cho phân tích khi giao dịch?
Như phần trước tôi đã nói trong phân tích OF, ta có 2 nhóm giao dịch trên thị trường là các giao dịch chủ động và thụ động

Khi phân tích OF ta cần chú ý tới DOM, khi giá chạm các mức high level và phản ứng đảo chiều hoặc lướt qua sẽ cho ta thấy sức mạnh của phe mua hay bán. Tại 1 khu vực giá cụ thể giá đang tăng hoặc giảm, trên DOM liên tiếp xuất hiện các mức high level và giá có xu hướng phản ứng lại các mức đó thì nó cho thấy đang có 1 khối lượng lệnh limit chờ đón tại đó và đang hấp thu toàn bộ các lệnh thi trường (chủ động), lúc này ta cần kiên nhẫn chờ kết quả của cuộc chiến và đi theo phe chiến thắng
Khi phân tích OF cần nhớ, giá có xu hướng hấp thụ từ từ 1 mức high level và tích lũy khối lượng lớn tại đó thì khi nó thoát khỏi khu vực đó sẽ làm thi trường mất cân bằng và di chuyển nhanh hơn, lúc này ta không nên giao dịch ngược lại vì thị trường có thể kích hoạt các lệnh stoploss hàng loạt làm giá di chuyển nhanh hơn đến mức cân bằng mới. Nếu tại 1 khu vực S/R, giá phản ứng ngay lập tức với 1 hoặc vài mức high level liên tiếp nhau và bật ngược trở lại với khối lượng không quá cao trong thời gian nhanh thì khả năng đã xảy ra stoploss hut.

23/4/2021

Cả nhà cho em hỏi ngu chút ạ?
Phương pháp wyckoff dùng cho thị trường FX kém hiệu quả hơn dùng cho chứng khoán đúng hay sai?
Theo em hiểu Pp wyckoff tức phân tích, đánh giá sự tương quan giữa khối lượng và hành động giá để đưa ra những suy đoán giúp ta phán đoán tình hình thị trường hiện tại và suy diễn kì vọng có thể xảy ra trong tương lai
Tuy nhiên ở chứng khoán sẽ dễ dàng hơn vì nó chỉ kiếm được lợi nhuận ở chiều Lên thôi do đó nó sẽ tuần tự qua các giai đoạn
Tích lũy > Tăng giá >Phân phối > giảm giá > quay lại tích lũy vì vậy khi đó ta áp cái "định lý"
Sức mạnh thể hiện trong thị trường Đi XUỐnG
Điểm yếu thể hiện khi thị trường Đi Lên trong wyckoff sẽ rất chi là phù hợp và đúng đắn.
FX thì lại khác FX nó kiếm ăn được cả khi buy hoặc sell vì trong FX thì tiền tệ lại chính là hàng hóa, khi trade một cặp Tiền thì tức khi ta buy đồng này cũng chính là sell đồng kia, tôi có thể buy GBP, bạn cũng có thể Buy USD vậy đồng GBP/USD Lên hay XUỐnG bây giờ là cuộc chiến tài lực của hai ta, lúc đó tôi sẽ rất khó đoán được khi nào giai đoạn nào là điểm yếu thực sự của bạn, hay giai đoạn nào thể hiện rõ ràng sức mạnh của bạn vì đơn giản ta không thể biết rõ tài lực của nhau. Không như cổ phiếu ,cổ phiếu trong chứng khoán có một số lượng cố định các bài test của cá mập sẽ rất chuẩn vì nó chỉ có một số lượng nhất định nó biết rõ giới hạn ở đâu nên ta folow nó bằng dựa trên pp wyckoff sẽ chuẩn hơn rất nhiều.
NÓI VẬY Không phải bảo Wyckoff không trade đc FX, bản thân em cũng đang vận dụng Wyckoff vào FX, đây chỉ đơn thuần là sự so sánh về hai thị trường khác nhau trên cùng một pp thôi, nói rõ vậy không bị hiểu lầm thì tội em.
Bài viết của em khá lủng củng với ngôn từ không đc chuẩn chỉnh mọi người bỏ qua cho
tuy nhiên đại ý em đã biểu đạt ở trên , em rất mong có người thảo luận tháo gỡ những khúc mặc bấy em rất rất cảm ơn ạ.

Nguyễn Hưng

Bản chất là trade stock luôn dễ hơn trade fx trong mọi trường hợp, bất kể phân tích nào đi nữa.
Vì fx là 2 chiều lên xuống, sẽ chỉ có 2 thế lực kèm cặp nhau để đè, còn stock như bạn nói, 1 là lên thì đôi bên có lời, 2 là cùng giảm giá thì chết cùng nhau.
Hơn nữa cổ phiếu đều có chung về độ chính xác vol, trong khi fx đa số dùng tick, và tick thường kém chính xác trong việc thể hiện sức nặng, đó đơn giản vậy thôi. Phân tích nào cũng đều như vậy, fx khó hơn stock
Phi Hùng
Tác giả

Hoa Lexuan
Theo em với chứng khoán thì áp dụng pp wyckoff là tối ưu nhất,
Nhưng không hẳn các pp phân tích kỹ thuật khác áp dụng vào chứng khoán okie hơn Fx, vì Sao? Cá mập thao túng thị trường bằng cách nào chính là nắm giữ một phần rất lớn khối lượng trong thị trường đó từ đó dễ dàng kiểm soát phần cung, về phần Cầu thì rất đơn giản rồi(kiểm soát đc điều này họ đã làm chủ cuộc chơi hoàn toàn) mà cổ phiếu trong chứng khoán nó có giới hạn nhất định việc nắm giữa để làm chủ cuộc chơi sẽ dễ dàng hơn FX nhiều, cổ phiếu dễ bị thao túng hơn FX suy ra chưa chắc áp dụng ptkt ở chứng khoán tốt hơn ở Fx

Nguyễn Quốc Sâm
mọi phương pháp đều có tính tương đối , nhưng về cấu trúc thị trường nó sẽ hơi khác nhau 1 tí , nhưng Quy luật của cụ Wyckoff thì đã tồn tại cả thập kỷ đã gọi là Quy luật thì nó luôn đúng trong FX nó sẽ xảy ra nhiều hơn trong khung time nhỏ hơn , nhưng tóm lại game FX nó khó và nó lớn nhất toàn cầu về volume giao dich trong 1 ngày

Nguyen Quang Trung
Quản trị viên

Anh em thấy FX khó giao dịch cũng có cái đúng, nó là OTC và vol ko hoàn hảo như stock. Tuy nhiên vấn đề lớn nhất là chu kỳ của FX nó dài hơn stock rất nhiều và chịu ảnh hưởng rất nhiều của chu kỳ kinh tế. Muốn nhìn bias FX thì phải xem xét từ MN chart
Tiêu Phong
FX nó là 2 đồng tiền sự tích luỹ hay phân phối nó là tương quan 2 dòng tiền, và nguồn vol FX nó ngon hay ko phụ thuộc vào data lấy từ đâu, Wychoff thì stock, indices, crypto sẽ hợp hơn.
Phi Hùng
Tác giả
Em cảm ơn những lời chia sẻ của mọi người ạ,
Tuy nhiên theo em việc dùng dữ liệu tick vol trong thị trường phi tập trung FX hay real vol trong chứng khoán không ảnh hưởng gì quá nhiều đến pp wyckoff ,còn vì Sao thì "anna coulling" tác giả cuốn volume price analysis , đã nêu rất rõ ràng trong cuốn sách của mình rồi, bản thân em cảm thấy rất hợp lý